

BlackRock[®]

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss

BlackRock Strategic Funds

Handelsregister Luxemburg: B 127481

Für das zum 31. Mai 2023 endende Geschäftsjahr

Inhaltsverzeichnis

| | |
|--|------------|
| Allgemeine Informationen | 2 |
| Schreiben der Vorsitzenden des Verwaltungsrats an die Anteilinhaber | 5 |
| Bericht des Anlageberaters | 7 |
| Bericht des Verwaltungsrats | 13 |
| Vergütungsbericht (ungeprüft) | 18 |
| Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens | 22 |
| Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre | 30 |
| Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen | 41 |
| Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile | 49 |
| Vermögensaufstellung | 60 |
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund | 60 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | 169 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund | 172 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | 224 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | 230 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | 235 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | 239 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | 250 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | 256 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | 261 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | 265 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | 283 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | 284 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | 314 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | 317 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | 327 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | 332 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | 334 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | 336 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | 338 |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund | 340 |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund | 395 |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund | 408 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund | 417 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund | 424 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund | 434 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | 462 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund | 466 |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund | 473 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | 569 |
| Anmerkungen zum Jahresabschluss | 573 |
| Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers | 604 |
| Anhang I – Anteilklassen (ungeprüft) | 607 |
| Anhang II – Globales Marktrisiko (ungeprüft) | 609 |
| Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) | 611 |
| Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („Offenlegungsverordnung“) | 630 |

Anteilszeichnungen erfolgen ausschließlich auf der Basis des aktuellen Verkaufsprospekts und des Basisinformationsblatts („PRIIPs KID“), ergänzt durch den letzten Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss sowie den Halbjahresbericht und den ungeprüften Halbjahresabschluss, wenn dieser nach dem Jahresbericht und dem geprüften Jahresabschluss veröffentlicht wurde. Entsprechende Exemplare stehen am Geschäftssitz der BlackRock Strategic Funds (die „Gesellschaft“) zur Verfügung und können beim Investor Servicing Team vor Ort, bei der Übertragungsstelle, bei der Verwaltungsgesellschaft oder den Vertriebsstellen angefordert werden. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Allgemeine Informationen“.

Der Jahresbericht erscheint in englischer Sprache. Die deutsche Übersetzung dient lediglich zur Information.

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

Denise Voss, Vorsitzende
Paul Freeman
Bettina Mazzocchi (ernannt am 6. Oktober 2022)
Barry O'Dwyer (zurückgetreten am 31. Juli 2022)
Geoffrey D. Radcliffe
Davina Saint
Keith Saldanha
Vasiliki Pachatouridi (ernannt am 3. März 2023)

Alle Mitglieder des Verwaltungsrates sind nicht geschäftsführende Mitglieder des Verwaltungsrates.

Bettina Mazzocchi, Geoffrey D. Radcliffe, Vasiliki Pachatouridi und Keith Saldanha sind Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe (BlackRock, Inc. ist die oberste Holdinggesellschaft der BlackRock-Gruppe, zu der die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberater und die Hauptvertriebsgesellschaft gehören).

Paul Freeman und Barry O'Dwyer sind ehemalige Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe. Denise Voss und Davina Saint sind unabhängige Verwaltungsratsmitglieder.

Verwaltungsgesellschaft

BlackRock (Luxembourg) S.A.
35A, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

Anlageberater

BlackRock Financial Management, Inc.
Park Avenue Plaza,
55 East 52nd Street,
New York, NY 10055,
USA

BlackRock Institutional Trust Company N.A.
400 Howard Street,
San Francisco CA 94105,
USA

BlackRock Investment Management LLC
100 Bellevue Parkway,
Wilmington, Delaware 19809,
USA

BlackRock Investment Management (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue,
London EC2N 2DL
Vereinigtes Königreich

BlackRock (Singapore) Limited
#18-01 Twenty Anson,
20 Anson Road,
Singapur, 079912

Unteranlageberater

BlackRock Asset Management North Asia Limited
16/F Champion Tower,
Tree Garden Road,
Central Hong Kong

BlackRock Investment Management (Australia) Limited
Level 26, 101 Collins Street,
Melbourne 3000,
Australien

BlackRock Japan Co., Ltd.
1-8-3 Marunouchi,
Chiyoda-ku,
Tokyo 100-8217,
Japan

Hauptvertriebsgesellschaft

BlackRock Investment Management (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue,
London EC2N 2DL
Vereinigtes Königreich

Verwahrstelle und Fondsbuchhalter

State Street Bank International GmbH, Zweigstelle Luxemburg
49, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

Übertragungs- und Registerstelle

J.P. Morgan SE, Niederlassung Luxemburg
6C, route de Trèves,
L-2633 Senningerberg,
Großherzogtum Luxemburg

Unabhängiger Wirtschaftsprüfer

Deloitte Audit, S.à r.l.
20 Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater

Bis 1. August 2023:
Linklaters LLP
35, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

Ab dem 2. August 2023:

Arendt & Medernach SA
41 Av. John F. Kennedy
L-2082, Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Wertpapierleihstelle

BlackRock Advisors (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue,
London EC2N 2DL
Vereinigtes Königreich

Zahlstellen

Tschechische Republik
UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia a.s.
Prag 4 – Michle, Želetavská 1525/1,
Postal Code 140 92,
Tschechische Republik

Allgemeine Informationen Fortsetzung

Dänemark

BlackRock Copenhagen Branch
Harbour House,
Sundkrogsgade 21,
DK-2100 Copenhagen,
Dänemark

Frankreich

CACEIS Bank
1-3 Place Valhubert,
75013 Paris,
Frankreich

Israel

Altshuler Shaham Group1
9A Habarzel St,
Ramat Hahayal,
Tel Aviv, Israel

Italien

Allfunds Bank, S.A.
con sede legale in Estafeta, 6 (La Moraleja)
Complejo Plaza de la Fuente, Ed.
328109 Alcobendas, Madrid (Spanna)
e sede secondaria in Via Bocchetto,
620123 Mailand
Italien

BNP Paribas Securities Services
Succursale di Milano
Piazza Lina Bo Bardi, 3
20124 Mailand,
Italien

Société Générale Securities Services S.p.A.
Via Benigno Crespi
19/A, MAC II,
20159 Mailand,
Italien

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.
Eingetragener Sitz
Piazza Salimbeni 3,
53100 Siena,
Italien

State Street Bank International GmbH
Succursale Italia
Via Ferrante Aporti 10,
20125 Mailand,
Italien

Banca Sella Holding S.p.A.
Piazza Gaudenzio Sella 1,
13900 Biella,
Italien

CACEIS Bank S.A.
Niederlassung Italien
Piazza Cavour 2,
20121 Mailand,
Italien

ICCREA Banca S.p.A.
Via Lucrezia Romana 41/47,
00178 Rom,
Italien

Luxemburg

(Zentrale Zahlstelle)
J.P. Morgan SE, Niederlassung Luxemburg
European Bank & Business Centre,
6C, route de Trèves,
L-2633 Senningerberg,
Großherzogtum Luxemburg

Polen

Citi Hadlowy
Bank Handlowy w Warszawie S.A.
ul. Senatorska 16
PL-00-923 Warschau
Polen

Schweden

BlackRock (Niederlande) B.V – Zweigniederlassung Stockholm
Malmskillnadsgatan 32,
111 51 Stockholm,
Schweden

Schweiz

State Street Bank International GmbH
München, Zweigniederlassung Zürich
Beethovenstrasse 19
CH-8027 Zürich,
Schweiz

Schweiz

BlackRock Asset Management
Schweiz AG,
Bahnhofstrasse 39,
8001 Zürich,
Schweiz

Vereinigtes Königreich

J.P. Morgan Europe Limited
UK Paying Agency
3 Lochside View
Edinburgh
Vereinigtes Königreich
EH12 9DH

Eingetragener Sitz

49, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

Allgemeine Informationen Fortsetzung

Anfragen

Soweit nichts anderes angegeben ist, richten Sie Anfragen an die Gesellschaft bitte an:

Schriftliche Anfragen:

BlackRock Investment Management (UK) Limited,
c/o BlackRock (Luxembourg) S.A.

P.O. Box 1058,

L-1010 Luxemburg,

Großherzogtum Luxemburg

Alle anderen Anfragen:

Fax: +352 462 685 894

E-Mail: investor.services@blackrock.com (EMEA)

clientservice.asiapac@blackrock.com (APAC)

latamcsmad@blackrock.com (Amerika)

Aktueller Prospekt

Der Prospekt der Gesellschaft sowie die jeweiligen Basisinformationsblätter („PRIIPs KID“) sind zusammen mit Exemplaren des Antragsformulars direkt beim Investor Service Centre, der Verwaltungsgesellschaft oder einer ihrer Niederlassungen oder Vertriebsstellen erhältlich. Exemplare der Gesellschaftssatzung, des Jahresberichts, des geprüften Abschlusses sowie des ungeprüften Zwischenberichts und Zwischenabschlusses sind ebenfalls kostenfrei bei einer dieser Stellen sowie bei den Zahlstellen erhältlich. Alle vorgenannten Dokumente sind zudem im Internet auf www.blackrockinternational.com verfügbar.

Vertretungen

Die Vertretung in Dänemark ist die BlackRock Copenhagen Niederlassung, Tochterunternehmen der BlackRock Investment Management (UK) Limited, Vereinigtes Königreich, Harbour House, Sundkrogsvej 21, Kopenhagen, DK 2100, Dänemark.

Der Vertreter in Israel ist Altshuler Shaham Group, 19A Habarzel St, Ramat Hahayal, Tel Aviv, Israel.

Die Vertretung in der Schweiz ist BlackRock Asset Management Switzerland Limited, Bahnhofstrasse 39, 8001 Zürich, Schweiz.

Bestand an Anlagen

Aktien werden in erster Linie anhand des Sitzlandes des Unternehmens klassifiziert, an dem der Fonds (jeder einzelne ein „Fonds“ und zusammen die „Fonds“) Anteile hält.

Die Klassifizierung von Unternehmens- und Staatsanleihen mit fester und variabler Verzinsung erfolgt vornehmlich anhand des Sitzlandes des Emittenten.

Liquiditätsinstrumente werden vornehmlich anhand des Sitzlandes des Emittenten klassifiziert.

Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) und Börsengehandelte Fonds („ETF“) werden vornehmlich anhand des Sitzlandes des OGA oder ETF klassifiziert.

Käufe und Verkäufe

Eine detaillierte Aufstellung sämtlicher, für die Fonds während des Berichtszeitraums erworbener bzw. verkaufter Anlagen ist auf Anfrage kostenlos beim eingetragenen Sitz der Gesellschaft oder bei den Niederlassungen der oben genannten Vertretungen erhältlich.

Vertriebsberechtigungen

Die Gesellschaft ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß Teil I des Gesetzes von Luxemburg vom 17. Dezember 2010 betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren in der aktuellen Fassung („das Gesetz von 2010“). Für den Vertrieb der Anteile von Fonds der Gesellschaft wurden in folgenden Ländern die entsprechenden aufsichtsrechtlichen Genehmigungen eingeholt oder entsprechende Mitteilungen gemacht: Bahrain, Belgien, Chile, China, Dänemark, Deutschland, Finnland, Frankreich, Griechenland, Irland, Island, Italien, Luxemburg, Malta, Niederlande, Norwegen, Österreich, Polen, Portugal, Schweden, Schweiz, Singapur, Slowakei, Spanien, Südkorea, Tschechische Republik, Ungarn, Vereinigte Arabische Emirate und Vereinigtes Königreich.

Die Gesellschaft ist ordnungsgemäß bei der Comisión Nacional de Mercado de Valores in Spanien unter der Nummer 626 registriert.

Schreiben der Vorsitzenden des Verwaltungsrats an die Anteilhaber

Mai 2023

Sehr geehrte Anteilhaberin, sehr geehrter Anteilhaber,

Mit diesem Schreiben möchte ich Sie über die Aktivitäten der BlackRock Strategic Fonds (die „Gesellschaft“ oder „BSF“) in den zwölf Monaten bis zum 31. Mai 2023 informieren. Zum 31. Mai 2023 gehörten 30 Fonds (einzeln „ein Fonds“ und zusammen „die Fonds“) zur Fondspalette der Gesellschaft.

Die vergangenen 12 Monate waren von einer beträchtlichen Volatilität an den globalen Aktienmärkten geprägt, die vor allem auf die Auswirkungen einer hohen Inflation, einer strafferen Geldpolitik und die anhaltenden Auswirkungen der russischen Invasion in die Ukraine zurückzuführen war.

Der Nachholbedarf der Verbraucher nach Ende der COVID-19-Pandemie sorgte für erhebliche Preissteigerungen, die während des gesamten Jahres 2022 anhielten. Die Notenbanken weltweit reagierten auf diese Entwicklungen, indem sie die zu Beginn der COVID-19-Pandemie eingeleiteten Unterstützungsmaßnahmen zurückzogen und die Zinsen im Verlauf des Berichtszeitraums regelmäßig erhöhten. Die Auswirkungen der Invasion Russlands in die Ukraine im Februar 2022 führten zu einer weiteren Verschärfung des Inflationsdrucks und der Unterbrechungen der Lieferketten. Abgesehen von den humanitären Kosten führten die von den westlichen Nationen gegen Russland in den ersten Monaten der Invasion verhängten Sanktionen insbesondere in Europa zu ernsthaften Problemen bei der Energieversorgung und zu einer Ausweitung der Störung des globalen Handelsverkehrs. Sowohl Russland als auch die Ukraine sind wichtige Rohstoffproduzenten: Russland gehört zu den weltweit größten Exporteuren von Öl, Gas und Kohle, während die Ukraine ein bedeutender Agrarexporteur ist, insbesondere für Weizen. Eine Reihe europäischer Nationen reagierte jedoch auf die Krise, indem sie die Energieeffizienz verbesserte und nach alternativen Energiequellen suchte.

Nach den starken Anstiegen Anfang 2022 begannen die Energiepreise im zweiten Halbjahr zu fallen, was den Inflationsdruck in den großen Volkswirtschaften der Welt teilweise reduzierte. Die Inflationsrate in den USA erreichte im Juni 2022 mit einem 40-Jahres-Rekord von 9,1 % ihren Höhepunkt. In der Eurozone erreichte der jährliche Preisanstieg im Oktober 2022 10,6 %, ging jedoch bis Mai 2023 wieder auf 6,1 % zurück. Die britische Inflationsrate stieg im Oktober 2022 auf 11,1 % und damit ebenfalls auf den höchsten Stand seit 40 Jahren, bevor sie im Mai 2023 auf 8,7 % zurückfiel. In den meisten anderen Industrieländern sind die Inflationsraten jedoch nur langsam gesunken, was die Zentralbanken vor zusätzliche Herausforderungen stellt.

Eine Reihe von COVID-19-bedingten Lockdowns in China beeinträchtigten die industrielle Produktion und die weltweiten Lieferketten über den größten Teil des Jahres 2022. Nach weitverbreiteten Protesten im November 2022 haben die chinesischen Behörden jedoch die Pandemie-Beschränkungen des Landes gelockert, was dem internationalen Handel und dem inländischen Wachstum einen potenziellen Schub verschaffen könnte.

Die anhaltend hohe Inflation in Verbindung mit steigenden Zinsen sorgte in der zweiten Jahreshälfte 2022 für Rezessionsängste. Robuste Wirtschaftsdaten Ende 2022 und in den ersten Monaten des Jahres 2023 trugen dazu bei, diese Sorgen zu lindern: Während die Aktivitäten in Bereichen wie der verarbeitenden Industrie und Bauindustrie zurückgingen, blieb die Arbeitsmarktentwicklung weitgehend stabil und die Privatanlegerausgaben erwiesen sich als robust. In seinem im April 2023 veröffentlichten World Economic Outlook Update prognostiziert der Internationale Währungsfonds („IWF“) eine Expansion der Weltwirtschaft von 2,8 % im Jahr 2023 und 3,4 % im Jahr 2022 gegenüber 6,1 % im Jahr 2021. Der IWF fügte hinzu, dass unter anderem aufgrund der Turbulenzen im Finanzsektor und des anhaltenden Konflikts in der Ukraine die Abwärtsrisiken überwiegen.

Die Märkte waren im März und April 2023 erneut volatil, da Bedenken hinsichtlich der Belastungen des globalen Finanzsystems durch eine straffere Geldpolitik aufkamen. Auf den Zusammenbruch der Silicon Valley Bank in den USA folgte ein Vertrauensverlust in die Credit Suisse der Schweiz, obwohl konzertierte Maßnahmen der Regulierungsbehörden die Lage beruhigen konnten. Im Mai 2023 sorgte eine Pattsituation zwischen Demokraten und Republikanern in den USA über die Kreditobergrenze der US-Regierung für Verunsicherung an den Börsenmärkten. Gegen Ende des Monats zeigten sich jedoch Anzeichen dafür, dass beide Seiten kurz davor standen, eine Einigung über die Anhebung der Schuldenobergrenze zu erzielen und dieses Thema konnte Anfang Juni 2023 beigelegt werden.

Auch die festverzinslichen Titel entwickelten sich im Berichtszeitraum deutlich volatil, wobei die Rendite der 10-jährigen US-Staatsanleihen im Herbst 2022 um bis zu 4,2 % stieg, bevor sie in geringem Maß zurückging. Steigen die Renditen, sinkt der Anleihekurs, sodass die Anleger erhebliche Kapitalverluste verzeichneten. Insbesondere lag für US-Staatsanleihen von Herbst 2022 bis zum Ende des Berichtszeitraums eine inverse Zinsstrukturkurve vor: das bedeutet, dass die kurzfristigen Zinsen höher sind als die langfristigen Zinsen, was ein Signal dafür war, dass die Märkte sich zunehmend um eine Verlangsamung des Wirtschaftswachstums sorgten. Auch höherwertige Unternehmensanleihen waren ähnlich schwach, wobei ihre Renditen (die sich umgekehrt zu den Anleihekursen bewegen) stärker anstiegen als die von Staatsanleihen.

Näheres zur Wertentwicklung der Fonds enthält der Bericht des Anlageberaters, in dem auch einige unserer Einschätzungen zum Anlageausblick näher erläutert werden. Insgesamt sank das verwaltete Vermögen der Gesellschaft („AUM“) um 21,96 % von 22.406,19 Mio. USD auf 17.484,68 Mio. USD. Als besonders schwach erwiesen sich dabei globale Aktien und Schwellenländer.

Schreiben der Vorsitzenden des Verwaltungsrats an die Anteilhaber

Mai 2023 Fortsetzung

Insbesondere die Abflüsse aus den folgenden Fonds wirkten sich erheblich auf den Gesamtrückgang des verwalteten Vermögens aus, der im Zwölfmonatszeitraum verzeichnet wurde. Der Wert des BlackRock Global Event Driven Fund sank um 37,58 % auf 3.439,60 Mio. USD, und der BlackRock Fixed Income Strategies Fund verlor 33,64 %, und schloss den Berichtszeitraum mit 2.879,31 Mio. EUR.

Das stärkste prozentuale Wachstum in Bezug auf das AUM verzeichneten der Asia Pacific Absolute Return Fund, der um 51,12 % auf 75,61 Mio. USD stieg, und der Sustainable Euro Bond Fund, der zum Ende des Berichtszeitraums um 28,10 % auf 663,80 Mio. EUR zulegte.

Zu den Schwachpunkten gehörte der Global Equity Absolute Return Fund, der 48,40 % seines verwalteten Vermögens verlor und auf 34,06 Mio. USD sank. Währenddessen verlor der Emerging Companies Absolute Return Fund 42,61 % und schloss bei 343,96 Mio. GBP.

In Europa gab es auch im Berichtszeitraum diverse Gesetzesänderungen, die sich auf Anleger auswirken könnten. Zu den wichtigsten Änderungen zählen:

- ▶ Ab dem 1. Januar 2023 hat die erweiterte PRIIPs-Verordnung wesentliche Veränderungen für die Fondsbranche mit sich gebracht, die zuvor von einer Ausnahmeregelung profitiert hatte. OGAW-KIIDs wurden durch die strengeren PRIIPs-KIDs-Anforderungen ersetzt. Die Änderungen betreffen die Berechnung der Risiken, der Wertentwicklung und der Transaktionskosten.
- ▶ Die Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) der Europäischen Union ist im März 2021 in Kraft getreten. Sie sieht neue Transparenz- und Berichtspflichten für Wertpapierfirmen vor, die sowohl auf Unternehmensebene als auch auf Produktebene gelten. Einige Teile des 2022 fertiggestellten Rahmenwerks sind Anfang 2023 in Kraft getreten. Gleichzeitig arbeitet die EU an einem EU-weiten Klassifizierungssystem oder -rahmen. Diese Klassifizierung soll Unternehmen und Investoren eine gemeinsame Sprache bieten, um festzustellen, inwieweit wirtschaftliche Aktivitäten als ökologisch nachhaltig betrachtet werden können. Es gibt auch Maßnahmen zur Verbesserung der Berichterstattung, wobei die Richtlinie über die Nachhaltigkeitsberichterstattung von Unternehmen (Corporate Sustainability Reporting Directive, „CSRD“) ab 2024 umgesetzt werden soll. Gemäß den CSRD-Vorschriften sind Unternehmen verpflichtet, über Nachhaltigkeit in ihren Versorgungsketten („Scope 3“) zu berichten und müssen darüber hinaus die doppelte Wesentlichkeit in ihre Berichterstattung einbeziehen. Das Prinzip der doppelten Wesentlichkeit in der Berichterstattung beschreibt die Anforderung, nicht nur darüber zu berichten, wie sich nachhaltigkeitsbezogene Aspekte auf das Unternehmen auswirken, sondern auch darüber, wie sich die Aktivitäten des Unternehmens auf Umwelt, Klima- und soziale Themen auswirken. Die luxemburgische Regierung hat weitere Schritte unternommen, um Investitionen in ökologisch nachhaltige Fonds zu fördern, indem sie die „taxe d’abonnement“ (Zeichnungssteuer) für Fonds, die bestimmte Umweltkriterien erfüllen, ermäßigt hat.
- ▶ Die neue Consumer Duty-Verordnung der britischen Financial Conduct Authority trat am 31. Juli 2023 in Kraft. Sie bezieht sich auf den Inhalt der Mitteilungen der Investmentfonds an Kleinanleger – einschließlich der im Vereinigten Königreich ansässigen oder im Vereinigten Königreich vertriebenen Fonds. Die Vorschriften schreiben Finanzdienstleistungsunternehmen eine Sorgfaltspflicht gegenüber ihren Privatkunden vor und verpflichten sie dazu, gute Ergebnisse für Privatkunden zu erzielen – und ihr diesbezügliches Vorgehen zu belegen. Die „höheren und klareren“ Verbraucherschutzstandards gelten jetzt für neue und bestehende Produkte, die zum Verkauf und zur Erneuerung im Vereinigten Königreich angeboten werden.

Mit freundlichen Grüßen,

Denise Voss
Vorsitzende
Juni 2023

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023

Marktrückblick

Nach den Abverkäufen in der ersten Jahreshälfte 2022, die durch die anfängliche Straffung der Geldpolitik und Russlands Einmarsch in der Ukraine verursacht wurden, blieben die Märkte über weite Strecken des Jahres sehr volatil, da die Befürchtungen zunahmten, dass die anhaltend hohe Inflation und die steigenden Zinsen in vielen wichtigen Volkswirtschaften der Welt zu einer Rezession führen könnten. Gegen Ende 2022 und Anfang 2023 erholten sich die Aktien jedoch, als die Inflationsraten in den USA und Europa zurückgingen, was die Hoffnung steigerte, dass sich das Tempo der Zinserhöhungen verlangsamen könnte.

Technologie- und Wachstumswerte, die bereits Anfang 2022 rückläufig waren, verzeichneten im Juni weitere starke Rückgänge. Nach einer langen Periode, während der starke Gewinne die Aktienkurse im Technologiesektor weiter nach oben trieben, wurden wieder schwächere Ergebnisse verzeichnet, während die Inflation und die steigenden Anleiherenditen den Barwert (der aktuelle Wert der in der Zukunft generierten Zahlungsmittel) der langfristigen Cashflows vieler wachstumsstarker Technologiegesellschaften verringerten.

Der Aktienmarkt als Ganzes erlitt im August und September weitere Einbußen, da die Ängste vor den potenziell rezessiven Auswirkungen des Zinsanstiegs zunahmten. Die Entscheidung der chinesischen Regierung, ihre „Zero-COVID“-Politik der Pandemie-Ära im November zu beenden, gab den globalen Aktienmärkten sowie den Rohstoffpreisen jedoch Auftrieb.

Auch wenn bestimmte Bereiche im Zwölfmonatszeitraum schwächelten, entsprachen die Unternehmensgewinne während des Zeitraums weitgehend den Erwartungen oder übertrafen sie und erwiesen sich somit als weiterer Faktor, der die Stabilität der Aktienkurse unterstützte. Finanzunternehmen profitierten beispielsweise weitgehend von höheren Zinsen und der guten Lage am Arbeitsmarkt.

In Europa entwickelten sich Aktien gegen Ende 2022 und Anfang 2023 sehr positiv, was auf die nachlassenden Ängste rund um die Energiepreise und dem hohen Engagement vieler europäischer Hersteller- und Luxusgüterunternehmen am chinesischen Markt zurückzuführen war. Spätere Daten aus China, die auf eine ungleichmäßige Erholung nach COVID-19 hindeuteten, ließen jedoch Befürchtungen aufkommen, dass sich das globale Wachstum verlangsamen könnte.

Eine Liquiditätskrise in Teilen des Bankensektors im März und April 2023 verdeutlichte die möglichen Folgen einer straffen Geldpolitik und weckte die Hoffnung, dass die Zinserhöhungsprogramme der Zentralbanken bald enden könnten. Dies führte zu einem Anstieg der Aktienkurse von Technologie- und anderen wachstumsstarken Unternehmen. Die fehlende Einigung zwischen dem demokratischen Präsidenten Joe Biden und seinen republikanischen Gegnern im US-Kongress über eine Anhebung der Obergrenze für die Kreditaufnahme der US-Regierung schürte unterdessen die Sorge über einen möglichen Zahlungsausfall, was dazu führte, dass die weltweiten Märkte Ende Mai hohen Schwankungen unterlagen.

Die unsichere Phase für die globalen Anleihemärkte setzte sich fort. Die Renditen 10-jähriger US-Staatsanleihen, die sich umgekehrt zu den Preisen bewegen, erreichten im Oktober einen Höchststand von 4,2%. Dieser Anstieg wurde zum Teil durch die äußerst negative Reaktion der Anleger auf umstrittene Pläne zur Steuersenkung verursacht, die Ende September von der britischen Regierung unter Liz Truss vorgelegt wurden. Die Renditen der 10-jährigen britischen Staatsanleihen stiegen auf 4,5%, bevor sie in den darauffolgenden Monaten zurückgingen. Indexgebundene Anleihen, die sich eher an den Inflationserwartungen als an den tatsächlichen Preissteigerungen orientieren, verzeichneten im Zwölfmonatszeitraum ebenfalls deutliche Verluste.

Wertentwicklung der Fonds

Wertentwicklung der Aktienfonds

Eine Tabelle mit den Renditen der primären Anteilsklasse jedes Fonds im Vergleich zum jeweiligen Referenzindex finden Sie auf den Seiten 10, 11 und 12. Es folgt eine kurze Zusammenfassung der Wertentwicklung der Fonds.

Der BlackRock European Absolute Return Strategies Fund legte um 3,68% zu und übertraf damit seinen Referenzindex, den 3-Monats-Euribor-Index, der um 1,74% stieg. Der BlackRock UK Equity Absolute Return Fund stieg um 4,94% gegenüber seinem Referenzindex, dem 3-Monats-SONIA-Index, der um 2,96% zulegte. Der BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund stieg im Laufe des Zwölfmonatszeitraums um 13,91% und übertraf damit seinen Referenzindex, den 3-Monats-SOFR-Index, der um 3,86% anstieg.

Der BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund legte im Zwölfmonatszeitraum um 6,11% zu und lag damit vor seinem Referenzindex, dem 3-Monats-SONIA-Index, der ein Plus von 2,96% erzielte. Der BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund stieg um 1,77% und blieb damit hinter dem 3-Monats-SOFR-Index zurück, der um 3,86% zulegte.

Der BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund stieg um 13,91% und übertraf damit seinen Referenzindex, den MSCI Emerging Markets Index, der ein Minus von 8,49% verzeichnete. Der BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund stieg um 2,25% und blieb damit hinter seinem Referenzindex, dem BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill, zurück, der um 3,14% zulegte.

Der BlackRock European Opportunities Extension Fund stieg um 7,51% und lag damit vor seinem Referenzindex, dem S&P Europe BMI Index (Developed Markets Only), der 4,18% gewann. Der BlackRock European Select Strategies Fund fiel um 2,55% und übertraf damit seinen Referenzindex, der 3,84% einbüßte. Der BlackRock Global Event Driven Fund fiel um 1,42%, gegenüber dem Anstieg von 3,14%, seines Referenzindex, dem BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill.

Der BlackRock Systematic ESG World Equity Fund stieg um 3,02% und lag damit vor seinem Referenzindex, dem MSCI World Index (Net Total Return), der um 2,07% zulegte. Der BlackRock Systematic Style Factor Fund stieg um 13,02%,

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023 Fortsetzung

während sein Referenzindex, der 3-Monats-SOFR-Index, mit 3,86% rentierte. Der BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund stieg um 0,88% und lag damit knapp vor seinem Referenzindex, dem MSCI All Country World Index (Net Total Return), der um 0,85% zulegte. Der BlackRock Global Real Asset Securities Fund fiel um 13,22%, während sein Referenzindex, der FTSE Custom Developed Core Infrastructure 50/50 EPRA/Nareit Developed Dividend+ Net Index, um 12,26% fiel.

Wertentwicklung der Anleihefonds

Der BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund verlor im Zwölfmonatszeitraum 2,39% und blieb damit hinter seinem Referenzindex, dem 3-Monats-SOFR-Index, zurück, der um 3,59% zulegte. Der BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund fiel um 0,04% und blieb damit hinter seinem Referenzindex, dem Euro Short-Term Rate Overnight Index, zurück, der um 1,31% stieg. Der BlackRock Global Absolute Return Bond Fund fiel um 4,04% und lag damit hinter seinem Referenzindex, dem 3-Monats-Euribor-Index, der ein Plus von 0,81% verzeichnete.

Der BlackRock Sustainable Euro Bond Fund fiel um 5,74% und entsprach damit der Wertentwicklung seines Referenzindex. Der Sustainable Euro Corporate Bond Fund verzeichnete einen Rückgang um 3,56% und lag damit hinter seinem Referenzindex, dem Bloomberg MSCI Euro Corporate Sustainable SRI Index, der einen Rückgang von 3,04% verzeichnete.

Wertentwicklung der Mischfonds

Der BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund fiel im Zwölfmonatszeitraum um 2,35% und blieb damit hinter seinem Referenzindex, dem Euro Short-Term Rate Overnight Index, zurück, der um 1,31% stieg. Das BlackRock Managed Index Portfolio – Conservative – verzeichnete einen Rückgang von 3,71%. Die Portfolios Defensive, Moderate und Growth fielen in Euro um 4,60%, 3,06% bzw. 2,91%. Keines der verwalteten Portfolios verfügt über eine Benchmark.

Aussichten

Während allgemein von einer schwierigen Erholung der Weltwirtschaft von der COVID-19-Pandemie erwartet wurde, haben die Jahre 2022 und 2023 eine Reihe von Herausforderungen gebracht, die alle Prognosen übertreffen. Die Pandemie hinterließ ein schwieriges Erbe aus Staatsverschuldung, Lieferkettenproblemen und steigender Inflation. Diese Herausforderungen wurden durch den

Einmarsch Russlands in der Ukraine noch erheblich verschärft, und die hohen Rohstoff- und Energiepreise belasteten Haushalte und Unternehmen weltweit.

Die Zentralbanken sahen sich gezwungen, ihre Geldpolitik schnell zu straffen, was dazu führte, dass sich die Wachstumsraten langsamer entwickelten. Durchwachsene Daten aus einer Reihe großer Volkswirtschaften im Jahr 2023 haben zu erheblicher Unsicherheit hinsichtlich der Wachstumsaussichten geführt. Auch wenn die Inflation ihren Höhepunkt erreicht hat, steht die Geschäftsaktivität unter starkem Druck und zahlreiche Regierungen haben ihre Prognosen für das Bruttoinlandsprodukt („BIP“) nach unten revidiert.

Unterdessen bekommen Verbraucher, Unternehmen und der globale Finanzsektor, dessen Stabilität bedroht ist, die Auswirkungen höherer Zinssätze zu spüren. Ein anhaltender Konjunkturabschwung könnte die Märkte im kommenden Jahr destabilisieren und wird sicherlich Auswirkungen auf die Art der Sektoren haben, die gut abgeschnitten haben. Die Wirtschaftsdaten des ersten Halbjahrs 2023 deuten jedoch darauf hin, dass die Inflationserwartungen allmählich zurückgehen, und es wird davon ausgegangen, dass die Zentralbanken in Kürze in der Lage sein werden, das Tempo der Zinserhöhungen zu drosseln.

Ungeachtet der hohen Volatilität, die während eines Großteils der Jahre 2022 und 2023 zu verzeichnen war, zeigt sich der Unternehmenssektor bislang weiterhin recht robust. Dadurch erscheinen die Bewertungen attraktiver.

Zweifellos gibt es Unternehmen, die den derzeitigen Sturm trotz einer heraufziehenden Konjunkturschwäche überstehen und sich gut entwickeln können. Gleichermaßen haben höhere Renditen von Anleihen dazu geführt, dass festverzinsliche Wertpapiere seit einiger Zeit besser bewertet sind als früher. Letztendlich wird es in den kommenden Monaten zweifellos Herausforderungen geben, aber es werden sich auch Chancen ergeben.

Juni 2023

Bericht des Anlageberaters

Performancerückblick

1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023 Fortsetzung

Umwelt-, Sozial- und Governance („ESG“)-Politik

In der Tabelle mit den Renditen wird der für die einzelnen Fonds gewählte Anlageverwaltungsansatz erläutert. Außerdem wird angegeben, welche Fonds gemäß der EU-Offenlegungsverordnung („SFDR“) ökologische oder soziale Merkmale fördern („Artikel-8-Fonds“) oder nachhaltige Anlagen als Ziel haben („Artikel-9-Fonds“). Weitere Einzelheiten dazu, wie Artikel-8- und Artikel-9-Fonds diese Merkmale und Ziele erreicht haben, sind im ergänzenden Abschnitt zu nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Jahresberichts enthalten.

Bei allen anderen Fonds, die nicht die SFDR-Kriterien für Fonds nach Artikel 8 oder 9 erfüllen, berücksichtigen die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Anlagen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Anlageberater hat bei seiner Auswahl von Anlagen Zugang zu einer Reihe von Datenquellen, einschließlich Daten zu wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (sog. „PAI“-Daten, abgeleitet von „Principal Adverse Impacts“). Obgleich BlackRock ESG-Risiken für alle Portfolios berücksichtigt und sich diese Risiken mit ökologischen oder sozialen Themen decken können, die mit den PAIs verbunden sind, verpflichtet sich der Fonds nicht, PAIs bei der Auswahl seiner Anlagen zu berücksichtigen, sofern im Prospekt nicht anders angegeben.

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023 Fortsetzung

In der folgenden Tabelle ist die Wertentwicklung der Hauptanlageklasse, ausgewählt als repräsentative Anteilklasse, für jeden Fonds aufgeführt. Gemäß dem jeweils im Prospekt ausführlich beschriebenen Anlageziel streben die Fonds keine Nachbildung der Wertentwicklung eines bestimmten Referenzindex an. Die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Erträge des Benchmarkindex werden nur als Referenz für diesen Jahresbericht und geprüften Abschluss angegeben. Die wichtigste Anteilklasse für den BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund und den BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ist die thesaurierende Anteilklasse D, für die BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth und BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate die ausschüttende Anteilklasse D. Die primäre Anteilklasse für alle anderen Fonds ist die thesaurierende Anteilklasse A. Die Wertentwicklungen für jede andere Anteilklasse wird auf Anfrage zur Verfügung gestellt.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit lässt nicht auf die künftige Wertentwicklung schließen und sollte nicht als alleiniges Kriterium für die Auswahl eines Produkts herangezogen werden. Alle Finanzanlagen sind mit gewissen Risiken verbunden. Deshalb unterliegen der Wert Ihrer Anlage und die daraus erzielten Erträge Schwankungen und Ihr anfänglicher Kapitaleinsatz kann nicht garantiert werden. Einen Großteil ihres Vermögens legen die Fonds in Wertpapiere an, die auf verschiedene Währungen lauten; Änderungen des jeweiligen Wechselkurses haben daher Auswirkungen auf den Wert der Anlage. Die Angaben zur Wertentwicklung verstehen sich vor Abgaben und Gebühren, die bei Zeichnung oder Rückgabe der Anteile fällig werden können. Höhe und Grundlage der Besteuerung können sich von Zeit zu Zeit ändern. Anteilszeichnungen erfolgen ausschließlich auf der Basis des aktuellen Verkaufsprospekts und des Basisinformationsblatts („PRIIPs KID“), ergänzt durch den letzten Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss sowie den Halbjahresbericht und den ungeprüften Halbjahresabschluss, wenn dieser nach dem Jahresbericht und dem geprüften Abschluss veröffentlicht wurde. Entsprechende Exemplare können beim Investor Servicing Team vor Ort (lokale Unternehmen oder Zweigstellen der BlackRock-Gruppe oder deren Administratoren), bei der Übertragungsstelle, bei der Verwaltungsgesellschaft oder den Niederlassungen und Vertriebsstellen sowie beim eingetragenen Firmensitz der Gesellschaft angefordert werden. Anteile am BSF dürfen nicht an US-Bürger oder an in den USA ansässige Personen ausgegeben werden. Die Fonds dürfen weder in den Vereinigten Staaten noch ihren Territorien oder Besitzungen zum Kauf angeboten oder verkauft werden.

| Name des Fonds | Ergebnis im Finanzzeitraum bis zum 31. Mai 2023 | | Wertentwicklung im Kalenderjahr | | | Auflegungsdatum | SFDR- Klassifizierung ⁽¹⁾ |
|--|---|-----------|------------------------------------|----------|--------------------|-----------------|---|
| | 1 Jahr | 2022 | 2021 | 2020 | | | |
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist⁽²⁾ | 1,77 % | 4,83 % | 8,80 % | (2,84) % | 17. Februar 2012 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index (compounded in arrears plus 26.1 basis point spread) | 3,86 % | 1,97 % | 0,18 % | 1,08 % | | | |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist | 3,41 % | 4,37 % | 7,44 % | 8,43 % | 31. August 2016 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index (compounded in arrears plus 26.1 basis point spread) | 3,86 % | 1,97 % | 0,18 % | 1,08 % | | | |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist⁽²⁾ | 13,91 % | 8,47 % | 10,29 % | 7,54 % | 22. Februar 2017 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index (compounded in arrears plus 26.1 basis point spread) | 3,86 % | 1,97 % | 0,18 % | 1,08 % | | | |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund 'A' Class Non Dist | (2,35) % | (11,65) % | 3,38 % | 7,19 % | 28. Januar 2011 | Sonstiges | |
| Euro Short-Term Rate Overnight Index | 1,31 % | (0,01) % | (0,47) % | (0,44) % | | | |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist | 6,11 % | (21,25) % | 9,83 % | 10,48 % | 17. Oktober 2018 | Sonstiges | |
| 3 Month SONIA Index (compounded in arrears plus 11.9 basis point spread) | 2,96 % | 1,52 % | 0,09 % | 0,29 % | | | |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund 'A' Class Non Dist | 13,91 % | (0,33) % | 3,86 % | (9,86) % | 18. September 2015 | Sonstiges | |
| MSCI Emerging Markets Index | (8,49) % | (20,09) % | (2,54) % | 18,31 % | | | |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund 'A' Class Non Dist | (2,39) % | (7,13) % | (12,25) % | 14,07 % | 12. Juni 2013 | Sonstiges | |
| 3 Month SOFR Index (JP Morgan EMBI Global Diversified Index (50%) / JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index (50%)) | 3,59 % | 1,70 % | 0,16 % | 1,08 % | | | |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund 'A' Class Non Dist | 1,32 % | (6,25) % | (1,16) % | 8,41 % | 6. Dezember 2017 | Sonstiges | |
| J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified 1-3 year Index | 1,16 % | (10,54) % | 1,04 % | 0,46 % | | | |

Die Zahlen in diesem Bericht sind vergangenheitsbezogen und geben nicht unbedingt einen Hinweis auf die künftige Wertentwicklung.

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023 Fortsetzung

| Name des Fonds | Ergebnis im Finanzzeitraum bis zum 31. Mai 2023 | | Wertentwicklung im Kalenderjahr | | Auflegungsdatum | SFDR- Klassifizierung ⁽¹⁾ |
|---|---|-----------------|------------------------------------|-----------------|--------------------------|---|
| | 1 Jahr | 2022 | 2021 | 2020 | | |
| BlackRock European Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist | 3,68% | (4,85)% | 8,31% | 8,72% | 27. Februar 2009 | Sonstiges |
| 3 Month Euribor (Industry Standard) Index | 1,74% | 0,34% | (0,56)% | (0,43)% | | |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund 'A' Class Non Dist | 7,51% | (24,63)% | 44,23% | 10,99% | 31. August 2007 | Sonstiges |
| S&P Europe BMI Index | 4,18% | (11,18)% | 25,14% | (1,45)% | | |
| BlackRock European Select Strategies Fund 'A' Class Non Dist | (2,55)% | (14,01)% | 2,31% | 2,24% | 19. August 2015 | Sonstiges |
| 75% Bloomberg Pan European Aggregate Index (Hedged EUR) / 25% MSCI Europe Index (Hedged EUR) | (3,84)% | (15,97)% | 2,65% | 3,24% | | |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund 'A' Class Non Dist | 15,80% | (19,18)% | 32,42% | 10,75% | 6. Dezember 2018 | Artikel 8 |
| MSCI Europe Index | 5,18% | (9,49)% | 25,13% | (3,32)% | | |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund 'A' Class Non Dist | (4,04)% | (1,67)% | (2,15)% | 2,65% | 25. Mai 2012 | Sonstiges |
| 3 Month EURIBOR Index | 0,81% | (0,32)% | (0,55)% | (0,39)% | | |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist | 5,28% | (10,81)% | (7,49)% | 14,89% | 12. Dezember 2018 | Sonstiges |
| 3 Month SOFR Index (compounded in arrears plus 26.1 basis point spread) | 3,86% | 1,97% | 0,18% | 1,08% | | |
| BlackRock Global Event Driven Fund 'A' Class Non Dist | (1,42)% | (2,78)% | 1,46% | 6,74% | 5. August 2015 | Sonstiges |
| BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill | 3,14% | 1,46% | 0,05% | 0,67% | | |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund 'A' Class Non Dist | (13,22)% | (24,63)% | 13,20% | 6,51% | 30. November 2017 | Sonstiges |
| FTSE Global Developed Core Infrastructure 50/50 Index (50%) / FTSE EPRA/Nareit Developed Dividend+ Index (50%) | (12,26)% | (17,13)% | 13,75% | (6,80)% | | |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative 'A' Class Non Dist | (3,71)% | (15,20)% | 7,59% | 0,35% | 26. Januar 2018 | Artikel 8 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive 'D' Class Dist | (4,60)% | (13,47)% | 3,87% | (0,22)% | 10. April 2015 | Artikel 8 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth 'D' Class Dist | (2,91)% | (18,29)% | 19,03% | 7,36% | 10. April 2015 | Artikel 8 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate 'D' Class Dist | (3,06)% | (14,13)% | 12,37% | 0,37% | 10. April 2015 | Artikel 8 |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund 'A' Class Non Dist⁽²⁾ | 13,02% | 1,63% | 14,17% | (23,28)% | 29. Februar 2016 | Sonstiges |
| 3 Month SOFR Index (compounded in arrears plus 26.1 basis point spread) | 3,86% | 1,97% | 0,18% | 1,08% | | |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund 'A' Class Non Dist⁽³⁾ | (5,74)% | (17,65)% | (4,01)% | 4,16% | 23. August 2016 | Artikel 8 |
| Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Index (Bloomberg Euro-Aggregate Index (80%) / Bloomberg Global Aggregate Index (20%)) | (5,74)% | (17,31)% | (2,98)% | 4,21% | | |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund 'A' Class Non Dist⁽³⁾ | (3,56)% | (14,28)% | (1,87)% | 2,79% | 21. Juni 2019 | Artikel 8 |
| Bloomberg MSCI Euro Corporate Sustainable SRI Index (Bloomberg Euro Corporate Index (80%) / Bloomberg Global Corporate Index (20%)) | (3,04)% | (13,48)% | (0,99)% | 2,70% | | |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund 'A' Class Non Dist⁽³⁾ | (1,39)% | (5,55)% | — | — | 1. März 2021 | Artikel 8 |
| Bloomberg MSCI Euro Aggregate 1-3 Years Sustainable SRI Index (Bloomberg Euro-Aggregate 1-3 Years Index (80%) / Bloomberg Global Aggregate 1-3 Years Index (20%)) | (1,69)% | (4,85)% | — | — | | |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund 'A' Class Non Dist⁽³⁾ | 1,06% | (5,13)% | (0,59)% | 1,15% | 11. Juni 2019 | Artikel 8 |
| Euro Short-Term Rate Overnight Index | 1,31% | (0,01)% | (0,47)% | (0,44)% | | |

Die Zahlen in diesem Bericht sind vergangenheitsbezogen und geben nicht unbedingt einen Hinweis auf die künftige Wertentwicklung.

Bericht des Anlageberaters Performancerückblick

1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023 Fortsetzung

| Name des Fonds | Ergebnis im Finanzzeitraum bis zum 31. Mai 2023 | | Wertentwicklung im Kalenderjahr | | Auflegungsdatum | SFDR- Klassifizierung ⁽¹⁾ |
|---|---|------------------|------------------------------------|-----------------|---------------------------|---|
| | 1 Jahr | 2022 | 2021 | 2020 | | |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund 'A' Class Non Dist⁽³⁾ | (0,04) % | (0,93) % | (1,54) % | 3,44 % | 30. September 2009 | Artikel 8 |
| Euro Short-Term Rate Overnight Index | 1,31 % | (0,01) % | (0,47) % | (0,44) % | | |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund 'A' Class Non Dist | 3,02 % | (19,70) % | 23,15 % | 17,69 % | 20. August 2015 | Artikel 8 |
| MSCI World Index | 2,07 % | (18,14) % | 21,82 % | 15,90 % | | |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund 'A' Class Non Dist⁽²⁾ | 0,88 % | (19,00) % | 17,67 % | 15,83 % | 18. September 2015 | Sonstiges |
| MSCI All Country World Index | 0,85 % | (18,36) % | 18,54 % | 16,25 % | | |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist⁽²⁾ | 2,25 % | 0,12 % | 2,65 % | (0,61) % | 2. Juni 2014 | Sonstiges |
| BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill | 3,14 % | 1,46 % | 0,05 % | 0,67 % | | |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist | 4,94 % | 6,85 % | 0,83 % | (1,37) % | 18. August 2016 | Sonstiges |
| 3 Month SONIA Index (compounded in arrears plus 11.9 basis point spread) | 2,96 % | 1,52 % | 0,09 % | 0,29 % | | |

⁽¹⁾ Die SFDR-Klassifizierung erfolgte zum Ende des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2023.

⁽²⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽³⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Die Erträge der Fondsp performance basieren auf Handelspreisen mit reinvestierten Nettodividenden (nach Abzug der Quellensteuer) und werden ohne Gebühren angezeigt.
Indexquellen: Indizes – Financial Times, MSCI, Citigroup, DataStream, MorningStar; Fonds – BlackRock Investment Management (UK) Limited.

Die Zahlen in diesem Bericht sind vergangenheitsbezogen und geben nicht unbedingt einen Hinweis auf die künftige Wertentwicklung.

Bericht des Verwaltungsrats

Grundsätze der Corporate Governance

Einleitung

BlackRock Strategic Funds (die „Gesellschaft“) ist eine als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (Société d'Investissement à Capital Variable) nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg errichtete Aktiengesellschaft (Société Anonyme). Die Gesellschaft wurde von der luxemburgischen Aufsichtsbehörde, der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“), als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß den Bestimmungen von Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung zugelassen und unterliegt deren Aufsicht gemäß diesem Gesetz. Die Gesellschaft befolgt die Grundsätze des vom luxemburgischen Fondsverband ALFI aufgestellten Verhaltenskodex in seiner revidierten Fassung von 2022 (der „Kodex“).

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft (der „Verwaltungsrat“) hat sich den höchsten Corporate-Governance-Standards verpflichtet und ist mit Blick auf die Führung der Geschäfte der Gesellschaft gegenüber den Anteilhabern rechenschaftspflichtig. Der Verwaltungsrat hat die Grundsätze und Empfehlungen des Kodex in einen Corporate-Governance-Rahmen für die Gesellschaft einfließen lassen, den der Verwaltungsrat zur Einhaltung der Grundsätze des Kodex für eine Anlagegesellschaft für angemessen hält. Der Verwaltungsrat ist der Auffassung, dass die Gesellschaft die Grundsätze des Kodex für das zum 31. Mai 2023 endende Geschäftsjahr eingehalten hat.

Nachstehend sind die während des Berichtsjahres vom 1. Juni 2022 bis zum 31. Mai 2023 geltenden Corporate-Governance-Strukturen und -Prozesse der Gesellschaft zusammengefasst.

Zusammensetzung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat besteht derzeit aus sieben nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern (einschließlich 2 unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern). Der Verwaltungsrat verpflichtet sich, für ein ausgewogenes Verhältnis von Kompetenzen, Erfahrung, Unabhängigkeit und Wissen seiner Mitglieder zu sorgen.

Die Biografien der Verwaltungsratsmitglieder auf den Seiten 15, 16 und 17 des vorliegenden Berichts spiegeln umfangreiches Anlagewissen und Erfahrung, Kompetenz in Geschäfts- und Finanzfragen sowie fundierte Kenntnisse der Gesetze und Vorschriften wider, die Voraussetzung für eine effektive strategische und ordnungsgemäße Führung und Kontrolle der Gesellschaft sind. Nach Auffassung von BlackRock ist die derzeitige Zusammensetzung des Verwaltungsrats angemessen und ausgewogen.

Artikel 13 der Satzung der Gesellschaft sieht gemäß luxemburgischem Recht vor, dass die Verwaltungsratsmitglieder auf der Jahreshauptversammlung von den Anteilhabern für die Dauer bis zur nächsten Jahreshauptversammlung und bis zur Wahl ihrer Nachfolger gewählt werden. Jedes Verwaltungsratsmitglied, das aus dem Amt scheidet, muss dem Verwaltungsrat und der luxemburgischen Finanzaufsichtsbehörde CSSF bestätigen, dass sein Ausscheiden nicht auf Probleme mit der Gesellschaft oder Ansprüche gegen diese zurückzuführen ist.

Der Verwaltungsrat unterstützt eine planmäßige und schrittweise Erneuerung des Verwaltungsrats. BlackRock verpflichtet sich sicherzustellen, dass die zur Wahl durch die Anteilhaber aufgestellten Verwaltungsratsmitglieder die für die Wahrung dieser Ausgewogenheit erforderlichen Fähigkeiten besitzen. Der Verwaltungsrat wiederum verpflichtet sich, seine Leistung und Aktivitäten jährlich zu überprüfen.

Die Verwaltungsratsmitglieder haben die ständige Pflicht sicherzustellen, dass sie über die zur Erfüllung ihrer Aufgaben erforderliche Zeit verfügen. Die Angaben zu den anderen Ernennungen und Verpflichtungen eines jeden Verwaltungsratsmitglieds (einschließlich der Verwaltungsratsvorsitzenden) werden dem Verwaltungsrat und der BlackRock-Gruppe zur Einsichtnahme zur Verfügung gestellt.

Bevor den Anteilhabern ein neues Verwaltungsratsmitglied zur Bestellung vorgeschlagen wird, erhält es eine umfassende Einführung mit wichtigen Informationen über die Gesellschaft und seine Aufgaben und Pflichten als Verwaltungsratsmitglied. Ferner muss ein neues Verwaltungsratsmitglied eine gewisse Zeit mit Vertretern von BlackRock verbringen, um sich mit den diversen Prozessen vertraut zu machen, die für eine ordentliche Erfüllung der Aufgaben und Pflichten gegenüber der Gesellschaft für notwendig erachtet werden.

Die Gesellschaft wird die Verwaltungsratsmitglieder dazu anhalten, sich laufend über die für die Gesellschaft wichtigen Entwicklungen zu informieren. Die Verwaltungsratsmitglieder haben an aktuellen Informationsveranstaltungen und Unterrichtungen von BlackRock-Gesellschaften teilgenommen und werden dies auch künftig tun. Des Weiteren erhalten die Verwaltungsratsmitglieder regelmäßige Unterrichtungen, unter anderem von den Wirtschaftsprüfern, Anlageberatern, Risikospezialisten, der Verwahrstelle und Rechtsberatern über geplante Produktentwicklungen oder Änderungen von Gesetzen oder Vorschriften, welche die Gesellschaft betreffen könnten.

Verantwortung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat trifft sich mindestens vierteljährlich und darüber hinaus bei Bedarf zu kurzfristig anberaumten Sitzungen. Dem Verwaltungsrat werden alle Informationen rechtzeitig und in angemessener Form und Qualität bereitgestellt, damit dieser seine Aufgaben erfüllen kann. Der Verwaltungsrat ist für den langfristigen Erfolg der Gesellschaft verantwortlich und sich seiner Verantwortung dafür bewusst, die Gesellschaft im Rahmen sorgfältiger und effektiver Kontrollen, die eine Beurteilung und Steuerung von Risiken ermöglichen, zu führen, zu lenken und zu kontrollieren. Der Verwaltungsrat behält sich Entscheidungen über die Festlegung der Anlagepolitik und Anlageziele, über die Änderung der Anlagestrategie, den Abschluss wesentlicher Verträge, die Änderung der Zusammensetzung des Verwaltungsrats, den Wechsel des externen Abschlussprüfers, die strafrechtliche Verteidigung oder Beilegung von Rechtsstreitigkeiten, die für die Gesellschaft wesentlich oder bedeutsam sind, und eine wesentliche Änderung der Rechnungslegungsgrundsätze vor. Der Verwaltungsrat genehmigt ferner den Prospekt und etwaige Ergänzungen dazu, Schreiben an Anteilhaber, Abschlüsse und alle anderen wichtigen rechtlichen Dokumente.

Bericht des Verwaltungsrats Fortsetzung

Die Hauptaufgabe der Vorsitzenden ist die Leitung und Führung des Verwaltungsrats, die Anregung kritischer Diskussionen und die Förderung einer effektiven Kommunikation innerhalb des Verwaltungsrats. Darüber hinaus obliegt es ihr, vorbildliche Corporate-Governance-Praktiken und eine effektive Kommunikation mit den Anteilhabern zu fördern.

Die Verwaltungsratsmitglieder können, falls erforderlich, auf die Beratung bzw. Dienstleistungen externer Berater sowie die Ressourcen von BIM UK und BlackRock (Luxembourg) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) zurückgreifen. Sofern dies für die Erfüllung ihrer Aufgaben erforderlich ist, können der Verwaltungsrat und einzelne Mitglieder des Verwaltungsrats eine unabhängige professionelle Beratung in Anspruch nehmen. Der Verwaltungsrat ist für die ordnungsgemäße Buchführung verantwortlich, aus der die Finanzlage der Gesellschaft jederzeit mit angemessener Genauigkeit hervorgeht. Dadurch soll gewährleistet werden, dass die Abschlüsse den jeweiligen Rechnungslegungsstandards entsprechen. Dem Verwaltungsrat obliegt die Vorlage einer ausgewogenen und verständlichen Beurteilung der Finanzlage der Gesellschaft. Diese Pflicht erstreckt sich auf die Zwischenabschlüsse und sonstigen Berichte, die den Anteilhabern oder der Öffentlichkeit bereitgestellt werden. Zudem fällt die Ergreifung angemessener Maßnahmen zum Schutz der Vermögenswerte der Gesellschaft und zur Verhinderung und Aufdeckung von Betrug und sonstiger Unregelmäßigkeiten in die Verantwortung des Verwaltungsrats.

Versicherung

Die Gesellschaft hat eine Organhaftpflichtversicherung mit angemessener Deckung abgeschlossen.

Übertragung von Aufgaben

Als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital überträgt die Gesellschaft den Großteil der im Tagesgeschäft anfallenden Management- und Verwaltungsaufgaben an Unternehmen der BlackRock-Gruppe wie die Verwaltungsgesellschaft. Diese bestellt spezielle Compliance- und Risikobeauftragte. Die Verwaltungsgesellschaft ernannt die Anlageberater und andere externe Dienstleister. Der Verwaltungsrat hat folgende Aufgabenbereiche übertragen:

Verwaltung und Administration

Der Verwaltungsrat hat die Anlageverwaltung, die Administration, die Vermarktung und den Vertrieb der Gesellschaft und ihrer Fonds an die Verwaltungsgesellschaft übertragen. Die Gesellschaft hat State Street Bank International GmbH, Zweigstelle Luxemburg, zur Verwahrstelle ihrer Vermögenswerte ernannt, die für die Verwahrung der Vermögenswerte im Einklang mit den geltenden Vorschriften verantwortlich ist. Die Verwahrstelle ist eine Tochtergesellschaft von State Street Bank & Trust Co.

Die Verwaltungsgesellschaft hat die Verwaltung des Anlageportfolios an die Anlageberater übertragen. Die Anlageberater arbeiten nach den vom Verwaltungsrat bestimmten Richtlinien, die im Prospekt der Gesellschaft für deren Fonds ausführlich beschrieben sind. Die jeweiligen Anlageberater tragen die direkte Verantwortung für Entscheidungen im Tagesgeschäft der Fonds der

Gesellschaft und legen gegenüber der Verwaltungsgesellschaft Rechenschaft über die Wertentwicklung der Fonds ab. Ferner hat der Verwaltungsrat die Ausübung der Stimmrechte, die mit den im Portfolio enthaltenen Wertpapieren verbunden sind, an die jeweiligen Anlageberater übertragen, die diese wiederum an BlackRock Investment Management (UK) Limited („BIM UK“) übertragen können. Die Ausübung von Stimmrechten im Namen der Anteilhaber erfolgt in einer Weise, die als im besten wirtschaftlichen Interesse von langfristig orientierten Anlegern betrachtet wird.

Die Verwaltungsgesellschaft hat ihre Pflichten zur Verwaltung der Gesellschaft und ihrer Fonds an State Street Bank International GmbH, Zweigstelle Luxemburg, übertragen (der „Administrator“). Der Administrator ist für die Administration der Geschäfte der Gesellschaft verantwortlich, einschließlich der Berechnung des Nettoinventarwerts und der Erstellung des Jahresabschlusses der Gesellschaft, wobei er der grundsätzlichen Überwachung durch die Verwaltungsgesellschaft unterliegt. Der Administrator ist eine Tochtergesellschaft der State Street Bank & Trust Co. Die Verwaltungsgesellschaft hat ihre Aufgaben als Übertragungs- und Registerstelle an J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. übertragen.

Die Verwaltungsgesellschaft hat den Vertrieb, die Verkaufsförderung und das Marketing der Anteile sowie die damit verbundene laufende Verwaltung und Verkaufsförderung an BIM UK als Hauptvertriebsstelle übertragen. Als Hauptvertriebsstelle ist BIM UK für das Angebot zum Verkauf, die Verkaufsförderung und das Marketing von Anteilen eines Fonds verantwortlich. BIM UK ist gegenüber der Verwaltungsgesellschaft für den Vertrieb und die Vermarktung der Anteile verantwortlich.

Die Verwaltungsgesellschaft ist dem Verwaltungsrat gegenüber für alle ihr übertragenen oder von ihr übertragenen Aktivitäten verantwortlich, einschließlich, jedoch nicht beschränkt auf die vorstehend genannten Aktivitäten.

Vierteljährlich und falls nötig öfter erstattet die Verwaltungsgesellschaft dem Verwaltungsrat Bericht. Mithilfe eines geeigneten Berichtswesens soll sichergestellt werden, dass der Verwaltungsrat die Aktivitäten seiner Beauftragten effektiv überwachen kann.

Die Verwaltungsgesellschaft ist für das Risikomanagement und die internen Kontrollen der Gesellschaft und die Überprüfung ihrer Wirksamkeit verantwortlich. Dadurch soll sichergestellt werden, dass die veröffentlichten oder im Unternehmen verwendeten Finanzinformationen zuverlässig sind und die für die Geschäfte der Gesellschaft geltenden Vorschriften regelmäßig überwacht werden. Die Verwaltungsgesellschaft überprüft laufend die Wirksamkeit der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme, um wesentliche Risiken für die Gesellschaft zu identifizieren, zu bewerten und zu steuern. Dieser Prozess beinhaltet Verfahren, um Mängel oder Schwächen aufzudecken und zu bewerten. Sollte der Verwaltungsrat einen bestimmten Fall als wesentlich einstufen, wird durch spezielle Verfahren sichergestellt, dass die erforderlichen Maßnahmen zur Beseitigung der Mängel ergriffen werden.

Bericht des Verwaltungsrats Fortsetzung

Die Prozesse zur Kontrolle der identifizierten Risiken (finanzielle, operationelle und Compliance-Risiken sowie Risikomanagement) sind in die Geschäftsprozesse der BlackRock-Gruppe und der Verwaltungsgesellschaft integriert. Zur Überprüfung dieser Kontrollen wurde ein Überwachungs- und Berichterstattungsprozess eingeführt, der während des gesamten Berichtszeitraums und bis zum Datum dieses Berichts in Kraft war und vom Corporate Audit Department von BlackRock durchgeführt wurde.

Die Abteilungen für die Interne Revision und operationelle Risiken von BlackRock erstatten dem Verwaltungsrat über die Verwaltungsgesellschaft auf vierteljährlicher Basis Bericht. Ferner berichten der Administrator und die Verwahrstelle der Verwaltungsgesellschaft über die internen Kontrollen der Verwaltungs- und Verwahrfunktionen der Gesellschaft. Der Verwaltungsrat ist sich bewusst, dass diese Kontrollsysteme das Risiko eines Verfehlens der Fondsziele nur steuern, nicht aber beseitigen können und lediglich angemessenen, aber keinen absoluten Schutz vor wesentlichen Fehldarstellungen oder Verlusten bieten können und dass diese Systeme auf Betriebskontrollen basieren, die von Dienstleistern eingerichtet wurden.

Finanzberichterstattung

Der Verwaltungsrat ist für die Einführung und Aufrechterhaltung angemessener interner Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Gesellschaft im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung verantwortlich. Zweck dieser Systeme ist vor allem die Steuerung und weniger die Beseitigung des Risikos, dass die Ziele der Finanzberichterstattung nicht erreicht werden. Die Gesellschaft hat Verfahren eingerichtet, um sicherzustellen, dass alle relevanten Bücher ordnungsgemäß geführt und ohne Weiteres zugänglich sind, einschließlich der Erstellung von Jahres- und Halbjahresabschlüssen. Diese Verfahren beinhalten die Bestellung des Verwalters, der die Bücher der Gesellschaft unabhängig vom Anlageberater und der Verwahrstelle führt. Der Jahresabschluss wird in Übereinstimmung mit geltendem Recht und den im Großherzogtum Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen („GAAP“) erstellt und vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt. Die im Jahresbericht enthaltenen Rechnungslegungsinformationen müssen geprüft werden. Der Bericht des Abschlussprüfers und etwaige darin enthaltene Einschränkungen werden im Jahresbericht vollständig wiedergegeben.

Vergütungspolitik

Die Gesellschaft ist eine Investmentgesellschaft ohne Mitarbeiter oder geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder. Kein (derzeitiges oder früheres) Verwaltungsratsmitglied hat Anspruch auf eine Pension von der Gesellschaft und die Gesellschaft gewährt weder Aktienoptionen noch langfristige Leistungsanreize. Die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder enthält keine erfolgsabhängige Komponente. Die Verwaltungsratsmitglieder, die auch Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe sind, haben keinen Anspruch auf eine Vergütung für ihre Tätigkeit im Verwaltungsrat. Alle anderen Verwaltungsratsmitglieder erhalten eine Vergütung, deren Höhe die Anteilinhaber bei der Jahreshauptversammlung beschließen und die auf Seite 581 angegeben ist. Der Verwaltungsrat ist der Auffassung, dass

die Höhe der Vergütung dieser Verwaltungsratsmitglieder ihre zeitliche Verpflichtung und ihre Verantwortung angemessen widerspiegelt. Der Verwaltungsrat hält die Vergütung angesichts der Größe, Komplexität und der Bandbreite der verwalteten Fonds für fair und angemessen. Die Obergrenze für die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder wird vom Verwaltungsrat beschlossen.

Kommunikation mit Anteilhabern

Der Verwaltungsrat ist für die Einberufung der Jahreshauptversammlung und aller anderen Hauptversammlungen der Gesellschaft verantwortlich. Anteilinhaber der Gesellschaft werden angehalten, an Hauptversammlungen und Abstimmungen teilzunehmen. Die Einladung zur Hauptversammlung erfolgt gemäß der Satzung der Gesellschaft und wird mindestens acht Tage vor der Versammlung versendet. Alle wesentlichen Angelegenheiten, die auf der Hauptversammlung vorgebracht werden, werden durch gesonderten Beschluss geregelt. Die Zahl der Stimmrechtsvertretungen wird vom Vorsitzenden der Hauptversammlung vermerkt.

Die nächste Jahreshauptversammlung der Anteilinhaber wird am 23. November 2023 abgehalten, und die Anteilinhaber werden gebeten, die üblichen Angelegenheiten, die auf einer solchen Versammlung vorgestellt werden, zu prüfen, einschließlich:

- ▶ Genehmigung des Jahresabschlusses & Dividendenausschüttung
- ▶ Genehmigung der Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrates
- ▶ Wahl oder Wiederwahl von Verwaltungsratsmitgliedern
- ▶ Wahl oder Wiederwahl des Abschlussprüfers
- ▶ Entlastung des Verwaltungsrats – dieser Beschluss ist nach luxemburgischem Recht erforderlich und die Entlastung ist nur gültig, wenn der Jahresabschluss keine Auslassungen oder falschen Angaben enthält, die die tatsächliche finanzielle Lage der Gesellschaft verbergen. Die Entlastung erfolgt auf der Grundlage der offengelegten Tatsachen und der den Anteilinhabern zum Zeitpunkt der Hauptversammlung zur Verfügung stehenden Informationen.

Der Ablauf von Hauptversammlungen ist in der Satzung der Gesellschaft geregelt.

BIM UK als Hauptvertriebsgesellschaft hat die Aufgabe, die Beziehung zwischen der Gesellschaft und ihren Anteilhabern zu steuern, und der Verwaltungsrat hat Kontrollen eingerichtet, sodass er über Beschwerden von Anteilhabern informiert wird.

Biografien der Mitglieder des Verwaltungsrats

Denise Voss (Vorsitzende) (US-Amerikanerin, wohnhaft in Luxemburg): Denise Voss ist ein nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied von Finanzdienstleistungsunternehmen und ist in Luxemburg ansässig. Sie gehört als Verwaltungsratsmitglied dem Verwaltungsrat von Vorzeige

Bericht des Verwaltungsrats Fortsetzung

Fonds großer Fondsgesellschaften an, darunter die BlackRock Global Funds und die BlackRock Strategic Funds. Davor war Denise Voss 25 Jahre lang für Franklin Templeton in Luxemburg als Geschäftsführerin und Verwaltungsratsmitglied im Geschäftsbereich Verwaltung von OGAW- und alternativen Investmentfonds des Unternehmens tätig. Bevor sie zu Franklin Templeton stieß, arbeitete Denise Voss zehn Jahre lang bei Coopers & Lybrand in Boston, USA und Luxemburg. Sie ist Inhaberin einer Wirtschaftsprüferlizenz (CPA) des US-Bundesstaats Massachusetts und hat an der Tufts University einen Bachelor-Abschluss erworben sowie an der Bentley University einen Master-Abschluss in Rechnungswesen. Denise Voss ist Vorsitzende von LuxFLAG, einer unabhängigen Organisation mit Sitz in Luxemburg, die infrage kommende Anlagevehikel mit anerkannten nachhaltigen Zertifikaten auszeichnet. Sie war zwischen 2015 und 2019 Vorsitzende des Verbands der Luxemburger Fondsindustrie (Association of the Luxembourg Fund Industry, ALFI) und zwischen 2007 und 2019 Mitglied des Verwaltungsrats von ALFI.

Geoffrey D. Radcliffe (britische und luxemburgische Staatsbürgerschaft, wohnhaft in Luxemburg): Geoffrey Radcliffe ist als Managing Director für BlackRock in Luxemburg tätig. Er ist Mitglied von BlackRock Business Operations & Technology, des Global Accounting und Product Services Teams und leitet die Abteilungen Product Oversight, Governance International für BlackRock EMEA- sowie die Asien-Pazifik-Region. Geoffrey Radcliffe ist Fellow beim Institute of Chartered Accountants in England and Wales und Associate beim Chartered Institute of Bankers. Er verfügt über eine mehr als 40-jährige Erfahrung in den Bereichen Anlagefonds, Wirtschaftsprüfung und Banking in verschiedenen Positionen in Luxemburg, Bermuda, London und Isle of Man. Geoffrey Radcliffe kam 1998 zur BlackRock-Gruppe. Er ist Vorsitzender des Verwaltungsrats der BlackRock Luxembourg S.A. und BlackRock Fund Management Company S.A. und Mitglied der Verwaltungsräte einiger anderer Unternehmen und Anlagefonds der BlackRock-Gruppe. Er war bis Juni 2023 10 Jahre lang Mitglied des Verwaltungsrats der ALFI (Luxembourg Fund Industry Association) und ist weiterhin Leiter und Teil der wichtigsten ALFI-Arbeitskreise.

Paul Freeman (Brite): Herr Freeman ist ein nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied mit über 40 Jahren Erfahrung in der Anlageverwaltungsbranche. Derzeit ist er Verwaltungsratsmitglied bei einer Reihe von Sondervermögen mit Sitz in Luxemburg und auf den Cayman-Inseln. Bis April 2022 war er nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied einer Reihe von Tochterunternehmen der BlackRock-Gruppe in Irland, einschließlich der OGAW/AIFM-Verwaltungsgesellschaft, für die er auch Vorsitzender des Investment Committees war. Bis Dezember 2015 war er Managing Director von BlackRock (er kam im August 2005 zur Gruppe). Zwischen Juli 2011 und Dezember 2015 arbeitete Paul Freeman eng mit dem Government Affairs Team von BlackRock zusammen und wirkte neben der Verwaltung von Fonds in verschiedenen internen Ausschüssen für interne Governance mit. Bis Juli 2011 war er Head of Product Development and Range Management für die EMEA-Region, wo er für die Entwicklung und laufende Produktverwaltung aller in der EMEA-Region ansässigen und von BlackRock

grenzübergreifend vertriebenen Fonds verantwortlich war. Vor seiner Zeit bei BlackRock bekleidete Herr Freeman Führungspositionen bei Schroders, Rothschild Asset Management, Henderson Investors und GT Management (inzwischen zu Invesco gehörend). Paul Freeman ist Chartered Accountant.

Keith Saldanha (Brite): Keith Saldanha ist Managing Director von BlackRock und Leiter der Wealth Product Group für Europa, den Nahen Osten und Afrika. Er ist verantwortlich für die Festlegung und Umsetzung der Produktagenda für Alpha und Alternativen für das BlackRock EMEA Wealth-Geschäft. Darüber hinaus leitet Keith Saldanha das Segment Fund Selection und Manager Research für die Vertriebsorganisation EMEA iShares & Wealth. Keith Saldanha ist Mitglied des EMEA Wealth Executive Committee, des EMEA Product Development Committee und des EMEA Capacity Management Committee. Er kam 2015 von der Man Group zu BlackRock, wo er als Global Head of Investment Marketing für eine Reihe von Produktspezialisten, Geschäftsentwicklungs- und Kundendienstteams in den Anlageverwaltungsgeschäften von Man verantwortlich war. Zuvor war er mehrere Jahre mit der Gründung und Ausführung der Fusions- und Übernahmeaktivitäten von Man-Hedgefonds sowie der gemeinsamen Leitung der Unternehmensstrategie für das Hedgefondsgeschäft befasst. Keith Saldanha begann seine Karriere in der Strategieberatung. Er ist Chartered Alternative Investment Analyst und besitzt einen BSc-Abschluss (Hons) in Wirtschaftswissenschaften der University of Warwick.

Davina Saint (Britin, wohnhaft in Irland): Frau Saint hat ihren Sitz in Dublin und ist nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied von Finanzdienstleistungsunternehmen sowie Verwaltungsratsmitglied der Irish National Assets Management Agency und sitzt im Verwaltungsrat, in Kredit- und Planungsausschüssen und hat den Vorsitz des Vergütungsausschusses inne. Frau Saint arbeitete über 20 Jahre bei der BNP Paribas Group als General Counsel für deren irisches Firmen- und institutionelles Bankgeschäft und zuletzt als Head of Branch für das irische Wertpapierdienstleistungsgeschäft von BNP Paribas. Bevor sie zu BNP Paribas kam, arbeitete sie in der City of London bei ABN Amro, nachdem sie sich als Rechtsanwältin auf den Bereich Schiffsrechtsstreitigkeiten spezialisiert hatte. Sie schloss den Abschluss in Rechtswissenschaften der London School of Economics mit Auszeichnung ab. Sie ist außerdem Chartered Director (CDir) und Certified Bank Director.

Bettina Mazzocchi (französische, britische und italienische Staatsbürgerin mit Wohnsitz im Vereinigten Königreich): Frau Mazzocchi ist Managing Director und Head of iShares and Wealth für Frankreich, Belgien, Luxemburg und Monaco. Bevor sie 2018 zu BlackRock kam, war sie seit 2008 bei PIMCO tätig, wo sie zuletzt Country Head für Frankreich war. Zuvor war Frau Mazzocchi bei Morgan Stanley, Bank of America und Credit Suisse First Boston tätig, wo sie sich auf Kreditderivate, strukturierte Kredite bzw. Fremdkapitalmärkte konzentrierte. Frau Mazzocchi ist Mitglied des Kuratoriums von YATI (Young Actors Theatre Islington), einer gemeinnützigen Gemeindefestspielgesellschaft für Jugendliche und Jugendliche in London, Großbritannien. Frau Mazzocchi ist Absolventin des Institut d'Etudes Politiques de Paris („Sciences Po“) und der Paris III Sorbonne Nouvelle.

Vasiliki Pachatouridi (britische und griechische

Staatsbürgerschaft): Frau Pachatouridi ist Managing Director und Head of iShares Fixed Income Product Strategy EMEA innerhalb der Indexed Fixed Income Portfolio Management Group (PMG) von BlackRock. Sie ist dafür verantwortlich, die Einführung von iShares Fixed Income ETFs und anderen indextierten festverzinslichen Strategien sowohl im institutionellen als auch im Vermögensverwaltungsbereich voranzutreiben. Frau Pachatouridi vertritt das Unternehmen außerdem gegenüber Kunden, Regulierungsbehörden, Branchenverbänden und Medien und setzt sich für die notwendige Modernisierung der Anleihemärkte ein, insbesondere in Bezug auf Handel, Liquidität und die Entwicklung von Indizes. Frau Pachatouridi ist seit 2007 für das Unternehmen tätig, einschließlich ihrer Zeit bei Barclays Global Investors (BGI), das 2009 mit BlackRock fusionierte. Zuvor gehörte sie dem Team von iShares EMEA Investment Strategies & Insights an, wo sie eine Analyse von ETF-Produkten sowie Anlagegeschäftsideen und Marktanalysen für eine Vielzahl von Kundinnen und Kunden durchführte. Bei BGI begann sie ihre Karriere im Transition Management Team. Frau Pachatouridi erwarb 2007 einen MSc-Abschluss mit Auszeichnung in Investment Management an der Cass Business School und 2006 einen BSc-Abschluss in Betriebswirtschaftslehre an der University of Bath.

Vergütungsbericht (ungeprüft)

Die nachfolgenden Informationen beziehen sich auf die Vergütungspolitik der BlackRock-Gruppe („BlackRock“), die für BlackRock (Luxembourg) SA (die „ManCo“) gilt. Die Offenlegung der Informationen erfolgt in Übereinstimmung mit der Richtlinie 2009/65/EG zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) in ihrer jeweils aktuellen Fassung, einschließlich der Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 (die „Richtlinie“) und den von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) veröffentlichten Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der OGAW-Richtlinie und der AIFMD.

Die OGAW-Vergütungsrichtlinie von BlackRock (die „OGAW-Vergütungsrichtlinie“) findet für solche EWR-Unternehmen der BlackRock-Gruppe Anwendung, die als Verwalter von OGAW-Fonds im Sinne der Richtlinie zugelassen sind, und stellt dadurch die Einhaltung der Anforderungen von Artikel 14b der Richtlinie sicher, sowie für britische Unternehmen innerhalb der BlackRock-Gruppe, die von der FCA als Verwalter eines britischen OGAW-Fonds zugelassen sind.

Die ManCo hat die nachfolgend zusammengefasste OGAW-Vergütungspolitik verabschiedet.

Vergütungs-Governance

Die Vergütungs-Governance in der EMEA-Region wird bei BlackRock im Rahmen einer mehrstufigen Struktur gesteuert; diese umfasst: (a) das Management Development and Compensation Committee („MDCC“) (dies ist ein globaler, unabhängiger Vergütungsausschuss für die BlackRock, Inc.); und (b) den Verwaltungsrat der ManCo („Verwaltungsrat der ManCo“). Diese Gremien sind für die regelmäßige Festlegung der Vergütungsrichtlinien von BlackRock zuständig und für deren Umsetzung verantwortlich.

Die Umsetzung der Vergütungsrichtlinien wird jährlich einer zentralen und unabhängigen Überprüfung unterzogen, um festzustellen, ob sie mit den vom MDCC und vom Verwaltungsrat der ManCo angenommenen Vergütungsrichtlinien und -verfahren übereinstimmt. Bei der jüngsten Prüfung wurden keine grundlegenden Mängel festgestellt. Die Offenlegung der Vergütung erfolgt durch das MDCC und den Verwaltungsrat des Managers und ist deren Eigentum.

Im Jahr 2022 wurden keine wesentlichen Änderungen an den Vergütungsrichtlinien vorgenommen.

(a) MDCC

Die Aufgaben des MDCC umfassen:

Aufsicht über:

- ▶ die Vergütungsprogramme für Führungskräfte von BlackRock;
- ▶ die Mitarbeiterbeteiligungspläne von BlackRock; und
- ▶ die sonstigen Vergütungspläne, die BlackRock eventuell von Zeit zu Zeit einführt und bei denen das MDCC als Verwalter gilt;

- ▶ Rückblick und Erörterung der Anmerkungen und Analysen zur Vergütung im jährlichen Proxy Statement von BlackRock, Inc. mit dem Management und Genehmigung der Aufnahme des MDCC-Berichts in das Proxy Statement;
- ▶ gegebenenfalls die Überprüfung, Beurteilung und Erstellung von Berichten und Empfehlungen für den Verwaltungsrat der BlackRock, Inc. („Verwaltungsrat der BlackRock, Inc.“) zum Talent-Management und zur Nachfolgeplanung, wobei Leistung und Nachfolge auf den höchsten Management-Ebenen im Mittelpunkt stehen; und
- ▶ Unterstützung der Verwaltungsräte der in der EMEA-Region regulierten Unternehmen der Gesellschaft bei der Einhaltung ihrer Verpflichtungen im Zusammenhang mit der Vergütung durch die Überwachung des Entwurfs und der Implementierung der EMEA-Vergütungsrichtlinie im Einklang mit der anwendbaren Verordnung.

Das MDCC arbeitet direkt mit der Semler Brossy Consulting Group LLC zusammen, einem unabhängigen Vergütungsberater, der nicht in einer Beziehung zu BlackRock, Inc. oder zum Verwaltungsrat der BlackRock, Inc. steht, die seine Fähigkeit beeinträchtigen würde, MDCC in Vergütungsangelegenheiten unabhängig zu beraten.

Aufgrund eigener Feststellungen des Verwaltungsrats der BlackRock, Inc., sind alle Mitglieder des MDCC „unabhängig“ im Sinne der Börsenzulassungsbestimmungen der New Yorker Börse („NYSE“). Gemäß diesen Bestimmungen müssen sie den Status eines „nicht angestellten Verwaltungsratsmitglieds“ haben.

2022 kam das MDCC zu 7 Sitzungen zusammen. Die Satzung des MDCC ist auf der Website der BlackRock, Inc. (www.blackrock.com) abrufbar.

Im Rahmen seiner regelmäßigen Überprüfungen überzeugt sich das MDCC, dass die Vergütungsrichtlinie und der gewählte Ansatz fortlaufend angemessen sind.

(b) Der Verwaltungsrat der ManCo

Der Verwaltungsrat der ManCo hat die Aufgabe, die für die ManCo und ihre ausgewiesenen Mitarbeiter geltende OGAW-Vergütungspolitik zu überwachen und zu beaufsichtigen.

Entscheidungsprozess

Die Entscheidungen über die Vergütung von Mitarbeitern werden einmal jährlich im Januar nach Abschluss des Performancejahres getroffen. Dieser Zeitpunkt wurde gewählt, damit das Geschäftsergebnis für das volle Jahr neben anderen nicht-finanziellen Unternehmenszielen berücksichtigt werden kann. Der Rahmen für Vergütungsentscheidungen ist zwar an das Finanzergebnis gebunden, es besteht aber ein erheblicher Ermessensspielraum bei der Festlegung der individuellen Vergütung, für die das Erreichen strategischer und operativer Ergebnisse sowie andere Aspekte wie Management- und Führungsqualitäten maßgeblich sind.

Für die Festlegung der jährlichen Bonuszahlungen werden keine Formeln aufgestellt und keine fixen Benchmarks verwendet. Bei der Festlegung der spezifischen individuellen

Vergütungsbericht (ungeprüft) Fortsetzung

Vergütungshöhe werden verschiedene Faktoren wie nicht-finanzielle Ziele und Vorgaben sowie das Finanzergebnis und die Anlageperformance insgesamt berücksichtigt. Diese Ergebnisse werden in ihrer Gesamtheit ohne spezielle Gewichtung betrachtet und es besteht kein direkter Zusammenhang zwischen einzelnen Leistungsbestandteilen und der Höhe des jährlichen Bonus. Die variable Vergütung, die einzelnen Mitarbeitern für ein bestimmtes Leistungsjahr zuerkannt wird, kann auch null sein.

Die jährlichen Boni werden aus einem Bonuspool gezahlt.

Das Volumen des geplanten Bonuspools, der eine Bar- und eine Aktienkomponente umfasst, wird über das Jahr hinweg vom MDCC geprüft und die endgültige Höhe des Bonuspools nach Jahresende genehmigt. Für diese Prüfung werden dem MDCC während des Jahres aktuelle und prognostizierte Finanzinformationen sowie die endgültigen Jahresabschlussinformationen zur Verfügung gestellt. Zu den Finanzinformationen, die das MDCC erhält und berücksichtigt, zählen unter anderem die Prognose zur Ertrags- und Aufwandsrechnung für das laufende Jahr und andere Finanzkennzahlen, verglichen mit Vorjahresergebnissen und den Planzahlen für das laufende Jahr. Außerdem prüft das MDCC auch andere Finanzkennzahlen von BlackRock (z.B. Nettozufluss an verwaltetem Vermögen und Anlageerfolg) sowie Informationen zur Marktlage und zum Vergütungsniveau bei Konkurrenzunternehmen.

Das MDCC befasst sich regelmäßig mit den Empfehlungen des Managements zum Anteil des Betriebsergebnisses vor Bonuszahlungen, der im Jahresverlauf zurückgestellt und als Vergütungsaufwand für die Barkomponente des gesamten jährlichen Bonuspools ausgewiesen wird (der „Rückstellungsbetrag“). Der Rückstellungsbetrag für die Barkomponente des gesamten jährlichen Bonuspools kann vom MDCC im Laufe des Jahres auf der Grundlage der vorstehend beschriebenen Prüfung der Finanzinformationen angepasst werden. Das MDCC wendet auf die Informationen, die es für die Festlegung des Umfangs des gesamten Bonuspools oder der Rückstellungen für die Barkomponente des gesamten Bonuspools berücksichtigt, keine besonderen Gewichtungen oder Formeln an.

Nach Ablauf des Leistungsjahres genehmigt das MDCC die Höhe des endgültigen Bonuspools.

Im Rahmen der Prüfungen zum Jahresende berichten die Abteilungen Enterprise Risk und Regulatory Compliance dem MDCC über alle bei Vergütungsentscheidungen zu berücksichtigenden Aktivitäten, Vorfälle oder Ereignisse.

Einzelne Mitarbeiter werden bei der Festlegung ihrer eigenen Vergütung nicht einbezogen.

Kontrollfunktionen

Jede der Kontrollfunktionen (Enterprise Risk, Legal & Compliance und Internal Audit) hat ihre eigene von den Geschäftsbereichen unabhängige Organisationsstruktur. Daher werden Mitarbeiter in Kontrollfunktionen unabhängig von den von ihnen betreuten Geschäften vergütet. Der Leiter jeder Kontrollfunktion ist entweder Mitglied des Global Executive Committee („GEC“) oder des globalen Managementkomitees oder hat eine Berichtspflicht gegenüber dem Verwaltungsrat

der BlackRock Group Limited, der Muttergesellschaft der regulierten EMEA-Unternehmen von BlackRock, einschließlich der ManCo.

Bonuspools nach Funktionen werden unter Bezugnahme auf die Leistung jeder einzelnen Funktion festgelegt. Die Vergütung der leitenden Angestellten der Kontrollfunktionen wird direkt vom MDCC überwacht.

Zusammenhang zwischen Bezahlung und Leistung

BlackRock verfolgt eine klar definierte Philosophie der leistungsorientierten Bezahlung und die Vergütungsprogramme sind darauf ausgelegt, die folgenden Kernziele zu erfüllen:

- ▶ das Geschäftsergebnis von BlackRock angemessen zwischen Aktionären und Mitarbeitern verteilen;
- ▶ Mitarbeiter anwerben, binden und motivieren, die einen wesentlichen Beitrag zum langfristigen Unternehmenserfolg leisten können;
- ▶ Abstimmung der Interessen führender Mitarbeiter mit denen der Aktionäre durch die Zuteilung von Aktien der BlackRock, Inc. als wesentlichen Bestandteil der jährlichen und langfristigen Leistungsanreize;
- ▶ Kontrolle der Fixkosten, indem sichergestellt wird, dass der Vergütungsaufwand je nach Profitabilität variiert;
- ▶ Kopplung eines wesentlichen Teils der Gesamtvergütung eines Mitarbeiters an das finanzielle und operative Ergebnis des Unternehmens;
- ▶ Förderung eines soliden und wirksamen Risikomanagements in allen Risikokategorien, einschließlich des Nachhaltigkeitsrisikos;
- ▶ Vermeidung einer übermäßigen Risikobereitschaft (ob in Bezug auf Nachhaltigkeit oder anderweitig); und
- ▶ Gewährleistung dass sich die kurzfristige, mittelfristige und/oder langfristige Vergütung nicht negativ auf die Kundeninteressen auswirkt.

Voraussetzung für die Förderung einer Leistungskultur ist die Fähigkeit, Leistung anhand von Zielen, Werten und Verhalten klar und durchgängig messen zu können. Die Führungskräfte verwenden für die umfassende Beurteilung der Mitarbeiterleistung eine 5-stufige Skala. Zudem führen die Mitarbeiter eine Selbstbewertung durch. Die endgültige Gesamtbeurteilung wird auf die Leistungsbeurteilung jedes Mitarbeiters abgestimmt. Bei den Mitarbeitern wird sowohl bewertet, wie sie ihre Leistung erreichen, als auch die absolute Leistung selbst.

Entsprechend der Philosophie der leistungsorientierten Bezahlung werden die Beurteilungen verwendet, um individuelle Leistungen hervorzuheben und zu belohnen, aber nicht um die Vergütung im Voraus festzulegen. Die Vergütungsentscheidungen werden ermessensabhängig im Rahmen des Verfahrens zur Jahresvergütung getroffen.

Vergütungsbericht (ungeprüft) Fortsetzung

Bei der Festlegung der Vergütungsniveaus werden neben der individuellen Leistung auch andere Faktoren berücksichtigt, darunter möglicherweise:

- ▶ die Performance des Managers, der von dem Manager verwalteten Fonds und/oder der betreffenden Funktion;
- ▶ für einen Mitarbeiter individuell relevante Faktoren; Beziehungen zu Kunden und Kollegen; Teamarbeit; Fähigkeiten; etwaige Verhaltensprobleme; und, vorbehaltlich aller geltenden Grundsätze, potenzielle Auswirkungen einer Beurlaubung auf den Beitrag zum Unternehmen;
- ▶ Risikosteuerung im Rahmen der für Kunden von BlackRock angemessenen Risikoprofile;
- ▶ strategische Geschäftsanforderungen, unter anderem Pläne zur Mitarbeiterbindung;
- ▶ Marktwissen;
- ▶ Bedeutung für das Geschäft; und
- ▶ Unterstützung der Ansätze des Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren sowie Diversität, Gerechtigkeit und Inklusion.

Ein primärer Produktaspekt ist das Risikomanagement. So werden Mitarbeiter zwar für eine starke Performance bei der Verwaltung ihrer Kundenanlagen vergütet, müssen aber das Risiko innerhalb der für ihre Kunden angemessenen Risikoprofile steuern. Daher werden Mitarbeiter nicht für riskante Geschäfte außerhalb festgelegter Parameter belohnt. Die Vergütungspraktiken bieten keine unangemessenen Anreize zur kurzfristigen Planung oder für kurzfristige finanzielle Gewinne, sie belohnen keine unangemessenen Risiken und bieten ein angemessenes Gleichgewicht zwischen den zahlreichen und erheblichen mit dem Geschäft der Anlageverwaltung, des Risikomanagements und der Beratung verbundenen Risiken.

BlackRock wendet ein Gesamtvergütungsmodell an, das ein vertragliches Grundgehalt und ermessensabhängige Boni umfasst.

BlackRock wendet ein System jährlicher ermessensabhängiger Bonuszahlungen an. Grundsätzlich kommen zwar alle Mitarbeiter für einen ermessensabhängigen Bonus in Frage, es besteht jedoch keine vertragliche Verpflichtung, einem Mitarbeiter einen ermessensabhängigen Bonus nach diesem System zu gewähren. Bei der Ermessensausübung im Zusammenhang mit der Gewährung eines ermessensabhängigen Bonus können die vorstehend (unter der Überschrift „Zusammenhang zwischen Bezahlung und Leistung“) aufgeführten Faktoren neben anderen Aspekten berücksichtigt werden, die bei der Ausübung von Ermessen im Laufe eines Performance-Jahres relevant werden können.

Ermessensabhängige Bonuszahlungen für alle Mitarbeiter, einschließlich Führungskräften, unterliegen einer Richtlinie, welche die Bar- und die BlackRock-Aktienkomponente der Bonuszahlung bestimmt und darüber hinaus zusätzliche Ausübungs-/Rückforderungsbedingungen festlegt. Die Zuerkennung von Aktien erfolgt vorbehaltlich einer weiteren Beurteilung der Wertentwicklung aufgrund der Veränderung des Aktienkurses der BlackRock, Inc. im Ausübungszeitraum. Mit der jährlichen Gesamtvergütung steigt auch die Aktienkomponente. Das MDCC hat diesen Ansatz 2006 beschlossen, um die Mitarbeiter stärker an das Unternehmen zu binden und das Vergütungspaket für entsprechende Mitarbeiter, wie Führungskräfte, stärker an den Interessen der Aktionäre auszurichten. Die Aktienkomponente wird in drei gleichmäßigen Raten über einen Zeitraum von drei Jahren nach Gewährung übertragen.

Ergänzend zu den vorstehend beschriebenen jährlichen ermessensabhängigen Bonuszahlungen kann an ausgewählte Mitarbeiter eine Aktienkomponente geleistet werden, um die Vergütung stärker an künftige Geschäftsergebnisse zu koppeln. Diese langfristigen Leistungsanreize werden individuell bestimmt, um sinnvolle Anreize für eine kontinuierliche Leistung über mehrere Jahre zu bieten, bei der die Bedeutung der Rolle des betreffenden Mitarbeiters, seine fachliche Kompetenz und seine Führungsqualitäten berücksichtigt werden.

Ausgewählte leitende Führungskräfte haben Anspruch auf leistungsorientierte, aktienbasierte Boni aus dem „BlackRock Performance Incentive Plan“ („BPIP“). Für die Boni aus dem BPIP gilt ein dreijähriger Performancezeitraum, der auf der Messung der bereinigten operativen Marge⁽¹⁾ und des organischen Umsatzwachstums⁽²⁾. Die tatsächliche Höhe des Bonus wird basierend auf der Performance von BlackRock mit Blick auf die angestrebten Finanzergebnisse am Ende des Performancezeitraums bestimmt. Die Höchstzahl der Aktien, die eine Führungskraft erwerben kann, beläuft sich auf 165 % des Bonus, wenn beide Kennzahlen die zuvor festgelegten finanziellen Ziele erreichen. Wenn das finanzielle Ergebnis von BlackRock bei beiden vorstehend genannten Kennzahlen unterhalb einer zuvor definierten Performance-Grenze liegt, werden keine Aktien zugeteilt. Diese Kennzahlen wurden als Schlüsselkennzahlen für einen über Marktzyklen hinweg gültigen Shareholder Value ausgewählt.

Eine begrenzte Anzahl von Mitarbeitern im Investmentbereich erhält einen Teil des jährlichen ermessensabhängigen Bonus (wie vorstehend beschrieben) in Form einer aufgeschobenen Barzahlung, die eine Anlage in ausgewählte, von einem Mitarbeiter verwaltete Produkte nominell nachbildet. Hintergrund ist die Absicht, Mitarbeiter im Investmentbereich entsprechend dem Anlageertrag der von ihnen verwalteten Produkte zu vergüten, indem die Vergütung in diese Produkte umgewandelt wird. Kunden und externe Gutachter beurteilen Produkte zunehmend positiv, bei denen für wichtige Anleger aufgrund ihrer bedeutenden persönlichen Anlagen „viel auf dem Spiel steht“.

⁽¹⁾ Bereinigte operative Marge: Bezeichnet, wie in der externen Berichterstattung von BlackRock, den bereinigten Betriebsgewinn geteilt durch den Gesamtumsatz nach Aufwendungen für Vertrieb und Serviceleistungen sowie Abschreibung der aufgeschobenen Verkaufsprovisionen.

⁽²⁾ Organisches Umsatzwachstum: Entspricht den im Jahr netto generierten neuen Basisgebühren zuzüglich des neuen Aladdin-Nettoumsatzes (in Dollar).

Vergütungsbericht (ungeprüft) Fortsetzung

Ausgewiesene Mitarbeiter

Die OGAW-Vergütungsrichtlinie legt das Verfahren fest, das zur Identifizierung von Mitarbeitern, d. h. Kategorien von Mitarbeitern der Verwaltungsgesellschaft (ManCo), verwendet wird, darunter Führungskräfte, Risikoträger, Kontrollfunktionen und andere Mitarbeiter, die sich aufgrund Ihrer Gesamtvergütung in derselben Einkommensstufe befinden wie die Geschäftsleitung und Risikoträger und deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf die Risikoprofile der ManCo oder der von ihr verwalteten Fonds haben.

Die Liste ausgewiesener Mitarbeiter wird regelmäßig überprüft, wobei eine formale Überprüfung unter anderem in folgenden Fällen erfolgt:

- ▶ organisatorische Veränderungen;
- ▶ neue Geschäftsinitiativen;
- ▶ Änderungen der Liste von Funktionen mit wesentlichem Einfluss;
- ▶ Änderungen von Aufgabenbereichen; und
- ▶ Veränderung des regulatorischen Umfelds.

Quantitative Offenlegung der Vergütung

Die Verwaltungsgesellschaft (ManCo) ist gemäß der Richtlinie zu einer quantitativen Offenlegung der Vergütung verpflichtet. Diese Offenlegung erfolgt in Übereinstimmung mit BlackRocks Verständnis der gegenwärtig verfügbaren regulatorischen Leitlinien über die quantitative Offenlegung der Vergütung. Aufgrund von Entwicklungen der Markt- oder regulatorischen Praxis, behält BlackRock sich das Recht vor, entsprechende Änderungen an der Art und Weise vorzunehmen, in der die quantitative Offenlegung der Vergütung berechnet wird. Werden solche Änderungen vorgenommen, kann dies zu Unterschieden zwischen den Offenlegungen eines Fonds im Vergleich zwischen dem aktuellen und dem Vorjahr oder im Vergleich zu Offenlegungen anderer BlackRock-Fonds im selben Jahr führen.

Offenlegungen werden vorgenommen in Bezug auf (a) die Mitarbeiter der ManCo; (b) Mitglieder der Geschäftsleitung; und (c) Mitarbeiter, die die Fähigkeit haben, das Risikoprofil des Fonds wesentlich zu beeinflussen, einschließlich Personen, die, wenn sie auch nicht direkt von der ManCo beschäftigt sind, von ihrem Arbeitgeber damit beauftragt sind, Leistungen direkt für die ManCo zu erbringen.

Alle Personen, die in den offengelegten aggregierten Werte berücksichtigt sind, werden gemäß der Vergütungsrichtlinie von BlackRock für ihre Verantwortlichkeiten im relevanten Geschäftsbereich von BlackRock vergütet. Da alle Personen Verantwortlichkeiten in einer Reihe von Gebieten erfüllen, wird nur jener Anteil der Vergütung für solche Leistungen von Personen in die offengelegten aggregierten Werte berücksichtigt, der dem Manager zuzuordnen ist.

Mitarbeiter und Mitglieder der Geschäftsleitung der ManCo erbringen üblicherweise sowohl OGAW-bezogene Leistungen als auch Leistungen ohne Bezug zu OGAW im Zusammenhang mit mehreren Fonds, Kunden und Funktionen der ManCo und im Rahmen der breiteren BlackRock-Gruppe. Umgekehrt erbringen Mitarbeiter und Mitglieder der Geschäftsleitung der breiteren BlackRock-Gruppe möglicherweise sowohl OGAW-bezogene Leistungen als auch Leistungen ohne Bezug zu OGAW im Zusammenhang mit mehreren Fonds, Kunden und Funktionen der breiteren BlackRock-Gruppe und der ManCo. Die offengelegten Zahlen bilden daher eine Summe jenes Teils der individuellen Vergütung des betreffenden Mitarbeiters, der nach einer objektiven Aufteilungsmethode, die das Multi-Service-Modell der ManCo und der breiteren BlackRock-Gruppe berücksichtigt, der ManCo zuzurechnen ist. Entsprechend drücken die Werte nicht die tatsächliche Vergütung einer Person oder deren Vergütungsstruktur aus.

Der Betrag der Gesamtvergütung der Mitarbeiter der ManCo für das am 31. Dezember 2022 endende Geschäftsjahr der ManCo beläuft sich auf 257,2 Mio. USD. Dieser Wert setzt sich aus einer festen Vergütung in Höhe von 147,8 Mio. USD und einer variablen Vergütung in Höhe von 109,5 Mio. USD zusammen. Diese Vergütung nach den oben beschriebenen Vorgaben wurde an insgesamt 12.029 Mitarbeiter ausbezahlt.

Der Betrag der aggregierten Vergütung der Mitglieder der Geschäftsleitung der ManCo für das am 31. Dezember 2022 endende Geschäftsjahr der ManCo beläuft sich auf 6,7 Mio. USD, die Vergütung der anderen Mitarbeiter, deren Tätigkeiten potenziell wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil der ManCo oder ihrer Fonds haben, betrug 9,0 Mio. USD. Diese Zahlen beziehen sich auf die gesamte ManCo und nicht auf den Fonds.

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Mai 2023

| | | BlackRock Strategic Funds Kombiniert | BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund |
|---|----------------|--|---|---|--|--|
| | Anmerkung | USD | USD | USD | USD | EUR |
| Aktiva | | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 17.459.037.778 | 723.816.857 | 73.326.887 | 42.857.832 | 745.553.747 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) | | (382.740.107) | (168.400) | (1.430.090) | (23.914) | 35.404.084 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 17.076.297.671 | 723.648.457 | 71.896.797 | 42.833.918 | 780.957.831 |
| Bankguthaben | 2(a) | 416.457.668 | 5.517.693 | 2.563.086 | 1.916.960 | 3.565.181 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 449.998.997 | 31.579.542 | 1.381.927 | 433.996 | 8.331.038 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 104.335.400 | 901.092 | 365.667 | 196.825 | 2.389.544 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 590.904.918 | 318.301.048 | 3.477.908 | 10.606.431 | 2.934.323 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 38.864.003 | 853.895 | 26.452 | 397.477 | 1.082.082 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs aus: | | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 17.062.767 | — | 172.621 | 288.280 | 180.470 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 100.598.783 | 660.514 | 1.885 | 5.373 | 3.945.019 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 236.388.731 | 105.258.966 | 4.819.618 | 6.646.393 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | 4.450.282 | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 78.034.371 | — | — | — | 4.887.328 |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 3.858.338 | — | — | — | 685.116 |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 375.856 | — | 97 | 15.971 | 19.048 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 19.117.627.785 | 1.186.721.207 | 84.706.058 | 63.341.624 | 808.976.980 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 149.147.348 | 2.088 | 234.149 | 1.518.719 | 1.278.299 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 55.877.882 | — | 3.204.319 | 1.204.451 | 3.734.350 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 31.856.100 | 6.662.720 | 581.285 | 273.813 | 583.215 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 622.137.223 | 350.535.523 | 2.855.890 | 9.558.519 | 728.733 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 53.805.300 | 4.437.793 | 52.906 | — | 1.601.835 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | 14.503.750 | — | — | — | — |
| Nicht realisierter Wertverlust aus: | | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 38.213.629 | — | 140.525 | 90.030 | 2.743.828 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 293.580.831 | 22.633.389 | 611.950 | 377.557 | 10.724.625 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 237.284.832 | 111.528.768 | 1.247.496 | 6.545.316 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | 4.258.648 | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 83.516.393 | — | — | — | 2.733.264 |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 19.864.986 | — | — | — | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 28.900.691 | 2.052.867 | 168.520 | 230.775 | 644.661 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 1.632.947.613 | 497.853.148 | 9.097.040 | 19.799.180 | 24.772.810 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 17.484.680.172 | 688.868.059 | 75.609.018 | 43.542.444 | 784.204.170 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund |
|---|----------------|---|---|--|---|
| | Anmerkung | GBP | USD | USD | USD |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 347.351.243 | 534.315.494 | 1.192.994.032 | 97.635.807 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) | | (6.727.226) | (109.104.441) | (220.028.133) | (14.975.021) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 340.624.017 | 425.211.053 | 972.965.899 | 82.660.786 |
| Bankguthaben | 2(a) | 7.874.320 | 4.408.844 | 33.251.284 | 1.471.918 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 4.790.225 | 18.732.559 | 20.658.740 | 2.589.494 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 828.992 | 890.811 | 19.934.676 | 1.138.195 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 14.224.821 | 15.234.590 | — | — |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 187.665 | 5.867.136 | — | 101.838 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 663.597 | 80.465 | 999.327 | 40.852 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 1.447.060 | 20.125 | 16.547.101 | 1.010.573 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 14.551.867 | 13.199.211 | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | 23.436.310 | 723.997 |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | 2.174.438 | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 51 | 6.132 | 18.940 | 869 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 385.192.615 | 483.650.926 | 1.089.986.715 | 89.738.522 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 469.160 | 1.218.905 | 16.433.645 | 219.905 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 7.216.473 | 3.689.472 | 8.844.087 | 662.311 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 618.763 | 286.020 | 1.188.064 | 15.490 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 18.801.982 | 16.093.283 | 2.741.908 | 926.366 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 212.162 | 142.468 | 178.301 | 18.346 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — | 899 | 484.790 | — |
| Nicht realisierter Wertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 361.364 | 404.027 | 730.008 | 152.300 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 2.176.554 | 815.068 | 55.611.779 | 1.517.190 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 10.973.370 | 12.665.343 | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | 9.717.644 | 2.422.975 |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | 2.584.860 | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 406.296 | 966.239 | 478.001 | 44.698 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 41.236.124 | 36.281.724 | 98.993.087 | 5.979.581 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 343.956.491 | 447.369.202 | 990.993.628 | 83.758.941 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | | BlackRock European Absolute Return Fund | BlackRock European Opportunities Extension Fund | BlackRock European Select Strategies Fund | BlackRock European Unconstrained Equity Fund |
|---|----------------|--|---|--|--|
| | Anmerkung | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 1.253.196.768 | 480.733.867 | 314.691.365 | 45.300.183 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) | | 87.848.424 | 120.188.252 | (11.169.131) | 12.650.987 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 1.341.045.192 | 600.922.119 | 303.522.234 | 57.951.170 |
| Bankguthaben | 2(a) | 1.221.619 | 5.185.086 | 2.509.663 | 31.146 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | — | 5.486 | 5.184.055 | — |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 2.879.900 | 1.343.061 | 2.605.508 | 46.657 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 61.912.227 | 6.720.701 | 1.860.136 | 122.729 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 1.036.382 | 879.509 | 462.979 | 613.218 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | 773.855 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 620.379 | 935.222 | 831.556 | 31.810 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 30.639.674 | 6.592.607 | 140.360 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | 741.975 | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | 11.616 | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 1.401 | 4.164 | 6.071 | 94 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 1.439.356.774 | 622.587.955 | 318.650.008 | 58.796.824 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 17.890.483 | 1.775.642 | 3.623 | — |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 5.091.937 | 451.710 | 60.677 | — |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 5.736.434 | 219.937 | 277.435 | — |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 19.623.785 | 6.059.571 | 1.130.495 | 723.651 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 1.671.241 | 432.895 | 313.518 | — |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — | 317.375 | 213.619 | — |
| Nicht realisierter Wertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | 294.666 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 358.568 | 131.487 | 2.271.471 | 772 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 14.530.430 | 6.408.642 | 24.518 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | 1.271.993 | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | 48.227 | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 8.341.479 | 1.040.317 | 398.988 | 350.901 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 73.244.357 | 16.837.576 | 6.309.230 | 1.075.324 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 1.366.112.417 | 605.750.379 | 312.340.778 | 57.721.500 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | | BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | BlackRock Global Event Driven Fund | BlackRock Global Real Asset Securities Fund |
|---|----------------|--|---|---------------------------------------|--|
| | Anmerkung | EUR | USD | USD | USD |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 90.246.431 | 33.766.394 | 3.456.110.378 | 965.824.272 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) | | (4.991.391) | (378.848) | (35.569.061) | (111.691.859) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 85.255.040 | 33.387.546 | 3.420.541.317 | 854.132.413 |
| Bankguthaben | 2(a) | 6.284.433 | 126.433 | 99.064.546 | 97.645.479 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 9.962.187 | 1.010.417 | 126.619.386 | 28.250.164 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 941.356 | 99.326 | 19.462.557 | 3.547.466 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 10.353.847 | 1.787.552 | 27.832.333 | 16.948 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 5.943 | 10.395 | 2.104.845 | 12.174.807 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 268.807 | 28.189 | — | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 1.715.498 | 645.239 | 2.369.351 | 65.315 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | 814.370 | 29.261.180 | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | 4.167.906 | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 1.261.479 | — | — | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 384.116 | — | — | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 37.424 | 505 | 56.458 | 4.253 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 120.638.036 | 37.909.972 | 3.727.311.973 | 995.836.845 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 1.680.305 | 1.534.648 | 1.539.971 | — |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 341.696 | 155.006 | 1.052 | — |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 128.744 | 92.471 | 6.672.182 | 20.803 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 11.267.318 | 393.905 | 102.281.212 | 9.994.718 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 1.623 | — | 16.347.334 | 522.662 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | 16.270 | — | — | 5.703.245 |
| Nicht realisierter Wertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 756.598 | 470.935 | 17.817.626 | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 2.368.132 | 887.122 | 84.441.369 | 2.680.505 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 1.350 | 299.277 | 52.475.714 | 777.373 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | 3.988.432 | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 3.104.578 | — | 1.573.535 | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 1.338.008 | — | — | 4.464.624 |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 177.151 | 11.915 | 4.561.651 | 1.100.823 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 25.170.205 | 3.845.279 | 287.711.646 | 25.264.753 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 95.467.831 | 34.064.693 | 3.439.600.327 | 970.572.092 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | | BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate |
|---|----------------|---|--|---|---|
| | Anmerkung | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 95.212.818 | 150.469.900 | 454.375.773 | 643.433.641 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) | | 1.642.165 | (2.660.500) | 18.543.865 | 7.981.229 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 96.854.983 | 147.809.400 | 472.919.638 | 651.414.870 |
| Bankguthaben | 2(a) | 156.360 | 453.588 | 567.757 | 1.129.072 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | — | — | — | — |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | — | 2.307 | — | — |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | — | 180.213 | — | — |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 197.120 | 45.197 | 1.207.996 | 2.019.488 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 660.345 | 2.998.122 | 4.082.566 | 8.709.152 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 2.401 | 2.537 | 5.575 | 2.607 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 97.871.209 | 151.491.364 | 478.783.532 | 663.275.189 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | — | — | — | — |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | — | — | — | — |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | — | — | — | — |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 109.767 | — | 361.350 | 1.220.114 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 88.004 | 225.549 | 841.515 | 798.760 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | 25.371 | 9.538 | 630 | 25.432 |
| Nicht realisierter Wertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 1.594.433 | 3.398.754 | 7.154.832 | 12.234.492 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | — | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 74.333 | 93.369 | 301.516 | 387.770 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 1.891.908 | 3.727.210 | 8.659.843 | 14.666.568 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 95.979.301 | 147.764.154 | 470.123.689 | 648.608.621 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | | BlackRock Systematic Style Factor Fund ⁽¹⁾ | BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽²⁾ | BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽²⁾ | BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾ |
|---|----------------|--|--|---|--|
| | Anmerkung | USD | EUR | EUR | EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 104.280.370 | 687.268.692 | 229.365.971 | 131.728.863 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) | | (67.089) | (32.852.243) | (6.140.725) | (3.659.524) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 104.213.281 | 654.416.449 | 223.225.246 | 128.069.339 |
| Bankguthaben | 2(a) | 16.622.799 | 1.034.568 | 743.886 | 251.164 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 9.011.529 | 3.748.794 | 1.423.644 | 569.276 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 337.889 | 4.654.432 | 2.080.751 | 756.339 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 7.897.615 | 6.361.879 | — | 4.032.310 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 4.588.516 | 342.196 | 133.726 | 8.687 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 2.625.442 | 645.016 | 116.674 | 284.778 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 4.099.762 | 600.788 | 251.181 | 154.217 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 7.073.809 | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 1.120.661 | 345.032 | 1.079.639 | 49.538 |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — | 25.554 | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 1.262 | 6.706 | 9.286 | 19.383 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 157.592.565 | 672.155.860 | 229.089.587 | 134.195.031 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 26 | 3.134.802 | 2.886 | 4.056.676 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 2.207.704 | 536.519 | 407.582 | 62.800 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 102.659 | 47.709 | 77.123 | 4.185 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 19.298.514 | 1.492.482 | 1.023.537 | 298.396 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 54.900 | 478.330 | 45.040 | 91.154 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | 60 | — | 54 | — |
| Nicht realisierter Wertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 663.697 | 309.972 | 91.850 | 100.338 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 7.886.341 | 1.128.401 | 585.474 | 310.273 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 5.727.537 | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 1.780.820 | 817.476 | 710.619 | 139.808 |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | 99.741 | 21.911 | 26.196 |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 174.122 | 310.317 | 104.775 | 62.626 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 37.896.380 | 8.355.749 | 3.070.851 | 5.152.452 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 119.696.185 | 663.800.111 | 226.018.736 | 129.042.579 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | | BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽²⁾ | BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽²⁾ | BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund ⁽¹⁾ |
|---|----------------|--|---|---|--|
| | Anmerkung | EUR | EUR | USD | USD |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 236.797.287 | 2.883.087.107 | 385.629.874 | 135.853.930 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) | | (7.636.720) | (125.180.666) | 20.241.230 | 2.998.361 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 229.160.567 | 2.757.906.441 | 405.871.104 | 138.852.291 |
| Bankguthaben | 2(a) | 24.528.576 | 77.965.935 | 4.673.489 | 1.570.129 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 13.219.560 | 144.156.009 | 280.528 | 53.576 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 2.736.695 | 29.696.184 | 1.045.045 | 425.981 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 557.666 | 60.104.217 | — | — |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 29.706 | 2.551.425 | 1.133.683 | 3.175 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 502.092 | 7.812.181 | 2.394 | 2.110 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 302.771 | 42.593.883 | 14.714 | 373 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 108.841 | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 2.747.776 | 38.300.923 | — | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 58.078 | 413.633 | — | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 9.423 | 38.888 | 8.779 | 1.711 |
| Gesamt Fondsvermögen | | 273.961.751 | 3.161.539.719 | 413.029.736 | 140.909.346 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | — | 87.776.651 | 42.175 | 257.689 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 89 | 10.645.470 | — | 5 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 600.512 | 5.983.932 | — | — |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 3.657.597 | 17.012.352 | — | — |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 121.995 | 22.235.605 | 562.866 | 284.450 |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | 100 | 7.178.786 | — | — |
| Nicht realisierter Wertverlust aus: | | | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | 1.777.860 | 10.069.966 | 50.733 | 12.036 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 905.719 | 58.153.047 | 334.173 | 17.082 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 18.288 | — | — | — |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | 5.001.017 | 49.930.848 | — | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | 31.805 | 10.436.455 | — | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 88.368 | 2.808.116 | 316.520 | 71.180 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 12.203.350 | 282.231.228 | 1.306.467 | 642.442 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 261.758.401 | 2.879.308.491 | 411.723.269 | 140.266.904 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | | BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | BlackRock UK Equity Absolute Return Fund |
|---|----------------|--|--|
| | Anmerkung | USD | GBP |
| Aktiva | | | |
| Wertpapiervermögen zu Anschaffungskosten | | 37.069.203 | 188.568.557 |
| Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) | | — | (177.912) |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 2(a) | 37.069.203 | 188.390.645 |
| Bankguthaben | 2(a) | 1.161.254 | 2.086.342 |
| Forderungen gegenüber Brokern | 15 | 350.580 | 3.141.032 |
| Ausstehende Zinsen und Dividenden | 2(a),2(d) | 883 | 1.161.236 |
| Forderung aus verkauftem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 6.458.132 | 12.955.244 |
| Forderung aus gezeichneten Fondsanteilen | 2(a) | 36.394 | — |
| Nicht realisierter Wertzuwachs aus: | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | 566.272 |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 27.699 | 223.880 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 4.479.157 | 5.494.320 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — |
| Gekaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — |
| Sonstige Vermögenswerte | 2(a) | 84.660 | — |
| Gesamt Fondsvermögen | | 49.667.962 | 214.018.971 |
| Verbindlichkeiten | | | |
| Barverbindlichkeiten gegenüber Banken | 2(a) | 40 | — |
| Verbindlichkeiten gegenüber Brokern | 15 | 14.229 | 3.384.770 |
| Zins- und Dividendenverbindlichkeiten | 2(a),2(d) | 96.754 | 415.378 |
| Verbindlichkeit aus erworbenem Anlagevermögen | 2(a),2(d) | 7.123.884 | 6.435.525 |
| Zahlungsverpflichtungen für zurückgenommene Anteile | 2(a) | 35.054 | — |
| Fällige Ertragsausschüttungen | 2(a),11 | — | — |
| Nicht realisierter Wertverlust aus: | | | |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — |
| Offene Devisentermingeschäfte | 2(d) | 979.584 | 3.171.596 |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 4.436.481 | 4.517.934 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — |
| Swaps zum Marktwert | 2(d) | — | — |
| Verkaufte Optionen/Swaptionen zum Marktwert | 2(d) | — | — |
| Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten | 2(a),4,5,6,7,8 | 383.673 | 1.312.196 |
| Gesamt Verbindlichkeiten | | 13.069.699 | 19.237.399 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | | 36.598.263 | 194.781.572 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023

| | Wahrung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 688.868.059 | 785.239.765 | 687.136.883 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf AUD lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | AUD | 222,21 | 196,95 | 170,72 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 112,15 | 110,40 | 90,95 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | SEK | 127,62 | 127,86 | 120,10 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | USD | 142,84 | 140,36 | 131,19 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 124,11 | 125,00 | 117,77 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 183,17 | 176,88 | 146,85 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 123,68 | 121,08 | 113,03 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 104,06 | 104,97 | 98,68 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 129,52 | 130,21 | 122,08 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 117,66 | 116,74 | 108,83 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 98,38 | 99,57 | 94,29 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 106,52 | 106,67 | 99,92 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | JPY | 10.197,20 | 10.325,84 | 9.650,34 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | SEK | 100,23 | 99,60 | 92,79 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | USD | 118,31 | 115,33 | 107,53 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 181,57 | 175,18 | 160,83 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 75.609.018 | 50.032.917 | 34.677.165 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf EUR lautender hedged ausschuttender Anteil der Klasse A | EUR | 109,88 | 109,36 | 104,61 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 130,06 | 125,85 | 104,88 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 125,09 | 119,39 | 100,65 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 128,75 | 124,50 | 117,65 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 135,22 | 130,21 | 108,33 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 113,86 | 112,73 | 107,49 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | GBP | 119,71 | 116,56 | 110,23 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 126,51 | 123,04 | 102,93 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 108,11 | 108,14 | 103,96 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 144,46 | 137,75 | 127,23 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | USD | 131,42 | 126,47 | 118,98 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | CHF | 113,02 | 112,58 | 106,88 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | EUR | 115,64 | 114,08 | 108,20 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 43.542.444 | 34.441.336 | 35.205.475 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 138,19 | 121,31 | 123,43 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 123,12 | 110,55 | 113,58 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 141,78 | 123,96 | 125,48 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 125,38 | 112,09 | 114,79 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 119,40 | 107,58 | 111,15 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | USD | 161,23 | 136,85 | 136,78 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 120,21 | 102,86 | — |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | EUR | 131,24 | 116,52 | 118,53 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | USD | 146,88 | 127,67 | 128,61 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 137,92 | 120,80 | 121,72 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Wahrung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|--------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | EUR | 784.204.170 | 1.128.995.831 | 1.229.637.507 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 119,78 | 122,66 | 132,13 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | SEK | 122,08 | 125,00 | 134,68 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 100,77 | 103,20 | 111,17 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 129,49 | 131,69 | 140,87 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 113,23 | 116,54 | 126,17 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 133,54 | 135,50 | 144,61 |
| Auf CAD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | CAD | 127,80 | 126,82 | 134,25 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | JPY | 10.671,11 | 10.997,03 | 11.674,51 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | SEK | 133,51 | 135,68 | 144,84 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | USD | 109,99 | 108,42 | 114,40 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 143,05 | 144,37 | 153,24 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | GBP | 343.956.491 | 599.297.873 | 820.997.763 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | CHF | 101,94 | 99,15 | 119,18 |
| Auf CNH lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | CNH | 972,45 | 927,68 | 1.074,29 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 106,29 | 102,32 | 122,72 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 110,41 | 103,37 | 123,18 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 107,99 | 102,29 | 121,46 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | AUD | 82,29 | 77,83 | — |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 105,74 | 102,35 | 122,40 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 108,24 | 103,70 | 123,91 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 113,47 | 106,94 | 126,42 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 117,76 | 109,69 | 129,54 |
| Ausschuttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 107,53 | 101,05 | 119,14 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | CHF | 107,29 | 103,56 | 123,47 |
| Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | JPY | 9.613,79 | 8.445,41 | — |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | JPY | 8.140,44 | 7.890,36 | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 115,27 | 108,33 | 127,60 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 109,80 | 104,89 | 124,74 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | USD | 119,58 | 111,07 | 130,89 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 114,90 | 107,97 | 127,08 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | AUD | 81,40 | 76,02 | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 126,81 | 117,96 | 137,34 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | CHF | 108,59 | 104,76 | 124,83 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 116,89 | 109,90 | 129,23 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 111,17 | 106,22 | 126,27 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | USD | 121,41 | 112,81 | 132,40 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 447.369.202 | 356.320.740 | 905.434.827 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 200,90 | 176,36 | 210,52 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | CHF | 90,07 | 83,18 | 101,30 |
| Ausschuttender Anteil der Klasse D | USD | 104,66 | 91,86 | 110,47 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 92,14 | 84,67 | 102,57 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 163,91 | 150,04 | 182,71 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 194,96 | 170,29 | 202,27 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 194,41 | 169,26 | 176,48 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 133,02 | 114,27 | 120,60 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 180,31 | 158,56 | 166,98 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 114,19 | 99,44 | 117,77 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 117,96 | 102,41 | 106,48 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 230,56 | 198,80 | 233,11 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse Z | GBP | 142,81 | 121,94 | 127,95 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | USD | 218,85 | 190,01 | 224,34 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Wahrung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 990.993.628 | 1.137.911.551 | 1.532.287.129 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 68,13 | 74,12 | 85,81 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 103,84 | 106,38 | 120,50 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 88,06 | 93,21 | 107,00 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | SEK | 77,11 | 81,35 | 93,20 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | CHF | 75,83 | 80,85 | 92,83 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 83,63 | 88,45 | 101,48 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 76,65 | 81,67 | 93,57 |
| Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 82,05 | 87,14 | 87,64 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 67,19 | 73,99 | 86,04 |
| Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 80,87 | 85,29 | 87,40 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 67,57 | 73,52 | 85,19 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 112,30 | 114,18 | 128,37 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | CHF | 79,11 | 83,75 | 95,40 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 95,83 | 100,72 | 114,75 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | USD | 98,88 | 101,80 | 115,89 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 85,06 | 90,48 | 104,40 |
| Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse I | EUR | 78,77 | 83,65 | 83,93 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I | EUR | 65,67 | 72,64 | 85,06 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil (G) der Klasse I | EUR | 62,50 | 68,81 | 79,97 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | USD | 64,88 | 69,44 | 79,95 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 84,31 | 88,36 | 100,28 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | USD | 111,81 | 113,47 | 127,33 |
| Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse X | EUR | 79,63 | 84,59 | 85,05 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 124,65 | 125,56 | 139,82 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | AUD | 102,87 | 105,66 | 118,31 |
| Auf CAD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | CAD | 91,59 | 92,89 | 103,79 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 83.758.941 | 96.295.844 | 77.615.734 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 108,65 | 107,23 | 118,60 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse AI | EUR | 80,92 | 85,55 | 99,46 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 95,02 | 96,81 | 108,36 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 110,76 | 108,92 | 120,04 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 98,03 | 99,53 | 110,95 |
| Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse E | EUR | 101,78 | 103,91 | 104,67 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse E | EUR | 77,80 | 82,28 | 95,66 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 121,88 | 120,49 | 117,58 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 93,54 | 95,77 | 107,77 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I ⁽²⁾ | USD | 103,44 | — | — |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 98,32 | 99,77 | 111,23 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 113,64 | 111,25 | 122,04 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | EUR | 1.366.112.417 | 1.529.883.902 | 1.528.371.943 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 153,24 | 147,80 | 143,48 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 153,29 | 147,85 | 143,52 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | EUR | 159,18 | 152,91 | 147,83 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 153,63 | 149,69 | 145,16 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 161,98 | 155,59 | 150,41 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 175,84 | 166,50 | 159,38 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 108,78 | 102,38 | 98,03 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 144,80 | 140,24 | 136,71 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 166,18 | 159,24 | 153,57 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S | EUR | 115,67 | 110,83 | 106,81 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 108,85 | 102,72 | 97,32 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 605.750.379 | 604.355.751 | 660.042.096 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 478,28 | 438,88 | 452,57 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 559,87 | 520,78 | 530,04 |
| Ausschüttender Anteil (G) der Klasse D | EUR | 202,43 | 189,38 | 193,51 |
| Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 497,31 | 454,24 | 465,61 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 585,32 | 541,89 | 548,87 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 529,17 | 494,65 | 505,90 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 312,34 | 288,48 | 291,50 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 378,80 | 346,05 | 346,17 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 312.340.778 | 381.911.389 | 485.703.169 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 100,13 | 103,64 | 112,38 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 102,53 | 105,21 | 113,59 |
| Auf CZK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | CZK | 1.090,95 | 1.062,26 | 1.116,18 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 94,24 | 96,70 | 104,40 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D | USD | 113,79 | 114,90 | 122,89 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 107,43 | 109,58 | 117,60 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse E | EUR | 98,43 | 101,51 | 110,14 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 98,63 | 101,71 | 110,36 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I | EUR | 98,52 | 101,97 | 110,57 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 105,09 | 106,99 | 114,61 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 114,25 | 115,52 | 123,00 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 57.721.500 | 59.071.043 | 46.793.755 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 190,80 | 164,76 | 167,90 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 195,95 | 167,37 | 169,88 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 199,39 | 168,75 | 169,82 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 185,55 | 159,92 | 163,63 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 156,36 | 130,32 | 129,64 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 197,63 | 168,67 | 170,39 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 202,12 | 171,19 | 171,44 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 218,49 | 183,82 | 184,49 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 95.467.831 | 155.153.613 | 159.454.244 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 97,14 | 101,23 | 105,63 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | SEK | 955,88 | 993,14 | 1.033,93 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 109,75 | 111,34 | 115,06 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D | GBP | 91,67 | 96,31 | 99,85 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 102,52 | 106,28 | 110,33 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 92,59 | 98,07 | 103,08 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 92,13 | 96,47 | 101,15 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 99,62 | 103,06 | 106,78 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | GBP | 102,32 | 104,30 | 107,15 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | SEK | 997,55 | 1.029,15 | 1.064,15 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 111,29 | 114,58 | 118,12 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 34.064.693 | 66.014.001 | 70.551.611 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 92,04 | 90,26 | 117,04 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 102,37 | 97,24 | 123,66 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 110,14 | 104,25 | 116,29 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 105,38 | 100,79 | 113,65 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 107,23 | 101,24 | 112,64 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 112,48 | 105,47 | 132,41 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | AUD | 84,70 | 80,51 | 101,74 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | USD | 105,07 | 99,36 | 125,79 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | CHF | 94,68 | 92,96 | 119,48 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | EUR | 96,35 | 93,60 | 120,23 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 100,40 | 95,97 | 122,21 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 3.439.600.327 | 5.510.059.457 | 6.020.440.310 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 102,19 | 106,78 | 112,56 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 125,74 | 127,55 | 132,75 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | CHF | 105,33 | 111,07 | 117,34 |
| Auf HKD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | HKD | 1.026,63 | 1.055,06 | 1.100,63 |
| Auf SGD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | SGD | 102,93 | 105,47 | 109,91 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 106,46 | 111,24 | 117,25 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 98,84 | 103,26 | 108,86 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 100,88 | 103,26 | 107,41 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 108,59 | 113,95 | 119,78 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 129,84 | 131,06 | 135,72 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 110,68 | 115,07 | 120,69 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 117,21 | 119,97 | 124,81 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 130,87 | 133,00 | 122,12 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 105,71 | 111,01 | 117,60 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | USD | 121,89 | 122,68 | 126,67 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 108,57 | 112,51 | 117,61 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 113,68 | 116,03 | 120,37 |
| Auf BRL lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | BRL | 99,99 | 100,37 | 87,34 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | JPY | 10.722,11 | 11.290,43 | 11.717,71 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | USD | 120,67 | 121,45 | 125,40 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | CHF | 105,25 | 110,18 | 115,46 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 113,18 | 117,33 | 122,71 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse IA | USD | 116,37 | 116,54 | 119,73 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse IA | EUR | 101,55 | 104,75 | 108,98 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S | USD | 106,84 | 107,53 | 111,01 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S | EUR | 101,16 | 104,85 | 109,63 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 152,65 | 152,12 | 155,50 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | CHF | 115,60 | 120,68 | 126,22 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | USD | 136,92 | 137,52 | 141,69 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 119,18 | 123,27 | 128,65 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 127,08 | 129,41 | 133,95 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Wahrung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 970.572.092 | 825.278.731 | 315.221.465 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | CHF | 66,94 | 89,86 | — |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | USD | 69,42 | 88,20 | 103,02 |
| Auf AUD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | AUD | 70,85 | 93,08 | — |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 64,01 | 84,76 | 100,71 |
| Auf CAD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | CAD | 72,00 | 93,13 | — |
| Auf CNH lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | CNH | 714,42 | 932,30 | — |
| Auf HKD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | HKD | 68,78 | 88,47 | 103,65 |
| Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | SGD | 67,63 | 87,70 | 102,79 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 112,18 | 129,27 | 138,79 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | CHF | 74,91 | 90,89 | — |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 75,61 | 91,13 | — |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | USD | 71,41 | 90,04 | 104,42 |
| Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D ⁽²⁾ | GBP | 83,12 | — | — |
| Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | SGD | 66,41 | 85,63 | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 115,92 | 132,77 | 141,69 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 121,73 | 140,56 | 133,11 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I | EUR | 70,56 | 92,86 | — |
| Ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | USD | 87,06 | — | — |
| Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | CHF | 84,61 | — | — |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | EUR | 83,71 | — | — |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | GBP | 86,12 | — | — |
| Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | SGD | 85,20 | — | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | USD | 80,77 | 92,40 | — |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | CHF | 75,76 | 91,24 | — |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 76,35 | 91,43 | — |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 77,65 | 91,67 | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | USD | 121,42 | 137,92 | 145,98 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | USD | 117,84 | 134,57 | 143,19 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | EUR | 95.979.301 | 92.812.104 | 101.728.225 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 100,04 | 103,90 | 109,60 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 100,47 | 104,34 | 110,07 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 111,78 | 112,70 | 117,47 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | EUR | 100,73 | 104,19 | 109,64 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 103,93 | 107,26 | 112,43 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 115,62 | 115,83 | 119,95 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 108,21 | 110,20 | 114,57 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 94,32 | 98,45 | 104,37 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽²⁾ | EUR | 101,70 | — | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 100,45 | 103,60 | 108,52 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Balance | EUR | 100,04 | 103,90 | 109,59 |
| Vermögensstrategie Moderat - Ausgewogen ausschüttender Anteil | EUR | 105,56 | 109,21 | 114,96 |
| Vermögensanlage99 konservativ thesaurierender Anteil ⁽²⁾ | EUR | 100,54 | — | — |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 147.764.154 | 158.057.000 | 159.169.033 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 97,25 | 102,58 | 108,56 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | GBP | 100,20 | 104,24 | 109,40 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 115,80 | 118,73 | 124,34 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 99,70 | 105,17 | 111,29 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 94,08 | 98,90 | 104,48 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 100,45 | 104,12 | 109,10 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 113,50 | 115,99 | 121,27 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 96,64 | 102,35 | 107,93 |
| Auf PLN lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D ⁽²⁾ | PLN | 1.043,85 | — | — |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 121,86 | 124,17 | 129,22 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 105,04 | 110,11 | 115,80 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 107,73 | 111,36 | 116,14 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 88,77 | 94,11 | 100,09 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽²⁾ | EUR | 98,70 | — | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 94,27 | 98,75 | 103,78 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 110,34 | 112,34 | 116,83 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Substanz | EUR | 93,00 | 98,10 | 103,81 |
| Vermögensstrategie Defensiv ausschüttender Anteil | EUR | 97,47 | 102,62 | 108,51 |
| Vermögensanlage ⁹⁹ defensiv thesaurierender Anteil ⁽²⁾ | EUR | 98,33 | — | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 104,61 | 109,18 | 114,30 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 470.123.689 | 444.803.756 | 369.847.480 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 139,00 | 144,07 | 149,81 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | GBP | 122,36 | 125,28 | 129,34 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 170,81 | 171,47 | 175,88 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 135,59 | 140,54 | 146,15 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 134,62 | 138,71 | 143,57 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 140,34 | 142,79 | 146,72 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 163,75 | 163,41 | 166,75 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 130,30 | 135,52 | 140,39 |
| Auf PLN lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D ⁽²⁾ | PLN | 1.077,85 | — | — |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 177,76 | 177,35 | 180,77 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 152,13 | 156,69 | 161,92 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 141,04 | 143,49 | 147,21 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 107,69 | 112,19 | 117,26 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽²⁾ | EUR | 104,28 | — | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 112,88 | 116,19 | 119,98 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 140,17 | 139,72 | 142,33 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Chance | EUR | 114,77 | 118,96 | 123,70 |
| Vermögensstrategie Wachstum ausschüttender Anteil | EUR | 126,45 | 130,27 | 134,75 |
| Vermögensanlage ⁹⁹ dynamisch thesaurierender Anteil ⁽²⁾ | EUR | 101,72 | — | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 140,81 | 144,38 | 148,53 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 648.608.621 | 782.947.401 | 695.253.941 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 119,59 | 124,13 | 128,60 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | GBP | 111,19 | 113,93 | 117,12 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 144,19 | 145,28 | 148,70 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 118,09 | 122,56 | 126,98 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 114,36 | 118,05 | 121,75 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 120,93 | 123,20 | 126,10 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 139,20 | 139,49 | 142,14 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 113,81 | 118,62 | 122,47 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 150,74 | 150,92 | 153,50 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 129,10 | 133,16 | 137,10 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 124,62 | 126,86 | 129,60 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 97,96 | 102,19 | 106,41 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I | EUR | 111,07 | 114,69 | 118,21 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 106,17 | 109,44 | 112,59 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 125,18 | 125,24 | 127,30 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Wachstum | EUR | 104,08 | 108,03 | 111,92 |
| IndexInvest Wachstum, auf CHF lautender, abgesicherter ausschüttender Anteil | CHF | 111,32 | 116,76 | 121,30 |
| Vermögensstrategie Ausgewogen ausschüttender Anteil | EUR | 111,94 | 115,64 | 119,18 |
| Vermögensanlage99 progressiv thesaurierender Anteil ⁽²⁾ | EUR | 100,73 | — | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 123,25 | 126,55 | 129,70 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | GBP | 121,09 | 122,71 | 124,83 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 127,75 | 127,29 | 128,93 |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | USD | 119.696.185 | 120.998.037 | 176.150.611 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | USD | 98,78 | 87,42 | 83,40 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 87,22 | 78,72 | 75,62 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 97,23 | 86,03 | 82,07 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 77,20 | 69,65 | 66,82 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | SEK | 80,20 | 71,95 | 68,74 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 79,40 | 72,06 | 68,93 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 106,24 | 93,16 | 77,56 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 102,45 | 90,15 | 85,52 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 89,91 | 80,72 | 77,10 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 88,72 | 78,28 | 74,14 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 97,96 | 86,83 | 73,07 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 83,23 | 75,51 | 72,91 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil PF der Klasse I | CHF | 82,62 | 74,74 | 71,19 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil PF der Klasse I | EUR | 91,56 | 81,94 | 78,66 |
| Auf BRL lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 75,59 | 66,09 | 52,21 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | CHF | 80,45 | 72,85 | 69,47 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | USD | 91,11 | 80,01 | 76,09 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 91,19 | 81,70 | 77,84 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 89,08 | 78,48 | 74,20 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | JPY | 9.156,87 | 8.331,96 | 7.918,17 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 108,78 | 95,02 | 89,48 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | AUD | 108,79 | 95,44 | 89,80 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 87,11 | 77,59 | 73,46 |
| Auf NZD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | NZD | 112,34 | 97,60 | 90,03 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 106,12 | 92,93 | 87,26 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | USD | 103,43 | 90,96 | 86,16 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | EUR | 90,98 | 81,62 | 77,84 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Währung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|--|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund⁽³⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 663.800.111 | 518.183.532 | 642.499.599 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 87,19 | 92,48 | 104,01 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 87,24 | 92,55 | 104,09 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 86,64 | 91,90 | 103,36 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 89,32 | 94,40 | 105,81 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 84,34 | 89,90 | 101,62 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 90,19 | 95,19 | 106,54 |
| Ausschüttender Anteil (G) der Klasse X | EUR | 82,97 | 88,48 | 98,94 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 92,59 | 97,33 | 108,50 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | EUR | 91,68 | 96,62 | 107,98 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽²⁾ | EUR | 99,19 | — | — |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund⁽³⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 226.018.736 | 258.151.903 | 271.817.140 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 89,63 | 92,94 | 102,60 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | SEK | 873,59 | 904,42 | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 88,82 | 92,08 | 101,65 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | EUR | 86,25 | 90,41 | 99,69 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 91,08 | 94,04 | 103,40 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 87,09 | 90,73 | 100,67 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 91,59 | 94,43 | 103,69 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | SEK | 881,57 | 907,73 | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 93,02 | 95,53 | 104,47 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽²⁾ | EUR | 101,65 | — | — |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund⁽³⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 129.042.579 | 158.812.825 | 238.040.560 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 94,33 | 95,66 | 99,62 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 94,30 | 95,62 | 99,62 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 95,08 | 96,07 | 99,72 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 93,36 | 95,10 | 99,50 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 95,21 | 96,15 | 99,74 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 96,07 | 96,64 | 99,85 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | EUR | 95,74 | 96,46 | 99,81 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽²⁾ | EUR | 100,90 | — | — |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund⁽³⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen | EUR | 261.758.401 | 367.772.840 | 385.400.409 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 98,71 | 97,67 | 103,33 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 98,71 | 97,67 | 103,33 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 97,88 | 96,85 | 102,49 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | EUR | 98,67 | 98,80 | 104,19 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 100,25 | 98,80 | 104,13 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 96,71 | 96,17 | 102,28 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 101,09 | 99,41 | 104,55 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 103,46 | 101,16 | 105,78 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Wahrung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund⁽³⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | EUR | 2.879.308.491 | 4.338.607.772 | 5.676.286.758 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | EUR | 105,34 | 105,38 | 108,25 |
| Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | CHF | 100,16 | 101,18 | 104,12 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | USD | 121,16 | 117,76 | 119,73 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | CHF | 100,42 | 101,46 | 104,42 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | JPY | 9.974,96 | 10.121,78 | 10.484,10 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 121,59 | 118,18 | 120,15 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 120,98 | 121,03 | 124,33 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 109,31 | 107,82 | 109,80 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 100,68 | 100,73 | 103,48 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | EUR | 103,50 | 104,84 | 107,43 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 111,49 | 111,05 | 112,72 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | USD | 118,54 | 116,67 | 118,37 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 103,28 | 103,93 | 106,55 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 124,81 | 120,82 | 122,38 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 127,60 | 127,14 | 130,08 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 115,68 | 113,65 | 115,29 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 113,17 | 113,78 | 117,47 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I | EUR | 122,80 | 124,05 | 126,97 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 129,19 | 128,49 | 131,21 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 114,93 | 111,06 | 112,29 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse S ⁽²⁾ | EUR | 98,09 | — | — |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S ⁽²⁾ | USD | 98,75 | — | — |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S | EUR | 100,44 | 99,92 | — |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S | USD | 103,47 | 100,12 | — |
| Ausschüttender Anteil der Klasse X | EUR | 101,48 | 102,80 | 105,35 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 139,88 | 138,28 | 140,37 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 411.723.269 | 440.371.155 | 358.338.671 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 189,45 | 183,89 | 196,28 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 204,00 | 196,63 | 183,58 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 201,91 | 196,33 | 184,88 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 160,75 | 161,79 | 174,96 |
| Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | JPY | 24.241,79 | 21.501,73 | 19.441,15 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | JPY | 18.102,16 | 18.453,94 | 19.668,58 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 257,39 | 243,57 | 228,82 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 140.266.904 | 145.106.726 | 185.067.316 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 176,14 | 174,61 | 190,08 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 193,91 | 190,92 | 181,53 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 180,92 | 179,67 | 172,55 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 144,14 | 149,81 | 167,05 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 153,98 | 151,68 | 164,06 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 193,15 | 189,65 | 180,05 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 140,44 | 137,79 | 148,44 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | EUR | 157,01 | 153,54 | 145,19 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | GBP | 240,45 | 232,00 | 222,06 |
| Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | JPY | 16.961,22 | 15.284,84 | 14.023,59 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre

zum 31. Mai 2023 Fortsetzung

| | Wahrung | 31. Mai 2023 | 31. Mai 2022 | 31. Mai 2021 |
|---|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | USD | 36.598.263 | 52.481.344 | 47.865.656 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | USD | 108,47 | 106,08 | 112,00 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 90,51 | 90,78 | 96,86 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | SEK | 920,71 | 917,73 | 977,04 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | EUR | 91,32 | 91,64 | 97,77 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse C | USD | 95,61 | 94,44 | 100,72 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 109,42 | 106,37 | 111,63 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | EUR | 99,04 | 98,73 | 104,72 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 104,88 | 102,84 | 108,11 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 89,66 | 90,39 | 96,96 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 93,17 | 92,62 | 99,27 |
| Ausschuttender Anteil der Klasse J | USD | 114,41 | 111,23 | 116,76 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | USD | 130,80 | 125,26 | 129,52 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Gesamt Netto-Fondsvermogen | GBP | 194.781.572 | 213.971.378 | 141.963.933 |
| Nettoinventarwert je: | | | | |
| Auf EUR lautender hedged ausschuttender Anteil der Klasse A | EUR | 110,23 | 106,53 | 100,23 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | EUR | 111,03 | 107,30 | 101,00 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 118,01 | 112,45 | 105,23 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | CHF | 112,45 | 109,27 | 102,60 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 124,22 | 119,24 | 109,30 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | EUR | 115,11 | 110,58 | 103,76 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | USD | 126,81 | 119,06 | 110,80 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 123,23 | 116,71 | 108,60 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 112,80 | 109,49 | 101,57 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | EUR | 107,27 | 104,11 | 98,06 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | EUR | 112,94 | 108,24 | 101,33 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | JPY | 11.734,83 | 11.423,48 | 10.637,96 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | USD | 124,28 | 116,41 | 108,08 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | GBP | 136,35 | 126,99 | 115,40 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geandert, nahere Informationen sind Erlauterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Auflegung einer neuen Anteilsklasse, nahere Informationen sind Anhang I zu entnehmen.

⁽³⁾ Geandertes Fondsname. Nahere Informationen sind Erlauterung 1 zu entnehmen.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr

| | Anmerkung | BlackRock | BlackRock | BlackRock | BlackRock |
|---|----------------|-------------------------------|--|---|---|
| | | Strategic Funds Kombiniert | Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | Asia Pacific Absolute Return Fund | Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ |
| | | USD | USD | USD | USD |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | | 22.406.187.773 | 785.239.765 | 50.032.917 | 34.441.336 |
| Erträge | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 35.168.071 | 5.953.862 | 35.706 | 245.812 |
| Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | 356.769.896 | 20.209.197 | 297.001 | 952.023 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 13.838.539 | — | 876.932 | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | 73.787.066 | — | — | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | 94.172.867 | — | 1.497.525 | 26.036 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 94.251.803 | 43.919.236 | 76.763 | 2.919.696 |
| Wertpapierleihe | 2(c),11 | 3.162.892 | — | 523 | — |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | 3.306.381 | — | — | — |
| Sonstige Erträge | | 59.133 | — | — | — |
| Gesamt Erträge | | 674.516.648 | 70.082.295 | 2.784.450 | 4.143.567 |
| Aufwendungen | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 3.579.877 | 104.884 | 184 | 6.698 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 81.524.158 | 12.101.933 | 51.633 | 1.449.114 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | 84.063.711 | — | — | — |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | 3.900.930 | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 119.756.602 | 63.545.340 | 1.796.286 | 2.786.294 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 26.793.551 | 1.170.506 | 99.531 | 37.991 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 | 7.596.380 | 1.212.012 | 43.194 | 211.845 |
| Steuern | 8 | 8.613.774 | 210.923 | 147.511 | 30.584 |
| Performancegebühren | 7,16 | 9.670.964 | 852.024 | 1.161 | 129.665 |
| Vertriebsgebühren | 4 | 5.536.118 | 18.529 | 30.081 | 5.928 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 142.019 | 5.324 | 388 | 245 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 153.261.488 | 8.520.179 | 233.141 | 55.430 |
| Sonstige Aufwendungen | | 186.708 | — | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | | 504.626.280 | 87.741.654 | 2.403.110 | 4.713.794 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | 1.784.818 | — | — | 182.478 |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | | 502.841.462 | 87.741.654 | 2.403.110 | 4.531.316 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | 171.675.186 | (17.659.359) | 381.340 | (387.749) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | (540.944.728) | (917.348) | (2.634.749) | (102.977) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | (331.121) | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 127.135.225 | 40.202.853 | 1.237.939 | 6.136.499 |
| Terminkontrakte | 2(d) | 334.923.563 | — | (509.621) | 244.761 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (80.888.585) | (23.919.256) | (968.453) | 155.970 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | (241.006.014) | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | 5.893.121 | — | — | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | (395.218.539) | 15.366.249 | (2.874.884) | 6.434.253 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | 137.962.682 | 809.592 | (217.847) | (103.764) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | (78.808) | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | (19.478.059) | (4.292.519) | 5.388.207 | 90.971 |
| Terminkontrakte | 2(d) | (96.486.495) | — | 168.836 | 261.490 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (270.176.481) | (28.530.564) | (653.618) | (558.974) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | 114.958.867 | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | 3.254.338 | — | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | (130.043.956) | (32.013.491) | 4.685.578 | (310.277) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | (353.587.309) | (34.306.601) | 2.192.034 | 5.736.227 |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 4.790.541.676 | 276.852.280 | 51.847.487 | 17.100.289 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (9.157.075.136) | (338.917.385) | (28.463.420) | (13.735.408) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | (4.366.533.460) | (62.065.105) | 23.384.067 | 3.364.881 |
| Angekündigte Dividenden | 11 | (84.233.075) | — | — | — |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | (117.153.757) ⁽²⁾ | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | 17.484.680.172 | 688.868.059 | 75.609.018 | 43.542.444 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Die kombinierten Zahlen wurden unter Anwendung der durchschnittlichen Wechselkurse im Jahresverlauf berechnet. Die daraus resultierende Wechselkursanpassung von (117.153.757) USD spiegelt die Veränderung des Wechselkurses zwischen dem 1. Juni 2022 und dem 31. Mai 2023 wider. Hierbei handelt es sich um einen fiktiven Betrag, der keinerlei Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der einzelnen Fonds hat.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund |
|---|--|---|--|---|
| | EUR | GBP | USD | USD |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 1.128.995.831 | 599.297.873 | 356.320.740 | 1.137.911.551 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 240.113 | 1.356.318 | 114.682 | 1.021.319 |
| Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) 21.965 | 7.933.549 | — | 67.955.983 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 213.044 | 815.603 | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 603.065 | — | — | 28.211.995 |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) 12.330.284 | 1.631.286 | 7.852.753 | 244.513 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 5.173.080 | 3.914.295 | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),11 257.245 | 51 | 166.773 | 234.867 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 301.885 | — | — | 21.363 |
| Sonstige Erträge | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | 13.754.557 | 16.307.328 | 12.864.106 | 97.690.040 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 46.542 | 276 | 12.150 | 1.585.544 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 5.410.390 | 3.151.901 | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 2.516.089 | — | — | 29.635.880 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) — | — | — | 3.362.370 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 5.276.940 | 2.639.730 | — |
| Jährliche Servicegebühr | 5 915.048 | 749.872 | 853.150 | 570.817 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 151.072 | 107.789 | 297.638 | 287.530 |
| Steuern | 8 114.443 | 117.368 | 2.725.460 | 397.014 |
| Performancegebühren | 7,16 — | — | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 578.771 | — | 170.553 | 92.724 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 7.381 | 3.886 | 2.260 | 7.360 |
| Verwaltungsgebühren | 4 6.307.740 | 4.351.052 | 3.607.740 | 1.863.497 |
| Sonstige Aufwendungen | 150.395 | — | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 10.787.481 | 16.017.573 | 13.460.582 | 37.802.736 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 — | — | — | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 10.787.481 | 16.017.573 | 13.460.582 | 37.802.736 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | 2.967.076 | 289.755 | (596.476) | 59.887.304 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) 43.551.315 | (18.379.084) | 18.297.765 | (88.206.117) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | 27.013.620 | 13.991.608 | — |
| Terminkontrakte | 2(d) (18.052.200) | (572.268) | (2.191.454) | (454.580) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) 5.049.881 | 4.832.203 | (3.603.986) | (74.008.382) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) (14.428.293) | — | — | 7.162.884 |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (2.476.569) | — | — | 3.926.317 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | 13.644.134 | 12.894.471 | 26.493.933 | (151.579.878) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) (45.150.586) | 16.981.660 | 13.424.831 | 54.424.320 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | (11.741.064) | 1.298.335 | — |
| Terminkontrakte | 2(d) 2.701.593 | 6.375.669 | 380.884 | (4.240.558) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (4.057.142) | 2.905.392 | (1.103.421) | (46.135.958) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) 8.062.091 | — | — | (14.262.558) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) 177.347 | — | — | 3.187.869 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | (38.266.697) | 14.521.657 | 14.000.629 | (7.026.885) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | (21.655.487) | 27.705.883 | 39.898.086 | (98.719.459) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | 148.627.030 | 32.673.359 | 144.619.672 | 2.298.390 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | (471.763.204) | (315.720.624) | (93.468.397) | (49.678.527) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | (323.136.174) | (283.047.265) | 51.151.275 | (47.380.137) |
| Angekündigte Dividenden | 11 — | — | (899) | (818.327) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | 784.204.170 | 343.956.491 | 447.369.202 | 990.993.628 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | BlackRock European Absolute Return Fund | BlackRock European Opportunities Extension Fund | BlackRock European Select Strategies Fund |
|---|--|---|--|---|
| | USD | EUR | EUR | EUR |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 96.295.844 | 1.529.883.902 | 604.355.751 | 381.911.389 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 73.280 | 695.903 | — | 60.124 |
| Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) 4.360.342 | 11.382.548 | 337.481 | 5.006.276 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 3.282.892 | 582.603 | 66.973 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 370.037 | — | — | 628.142 |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) — | 6.155.550 | 8.002.845 | 3.431.271 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 5.165.245 | 3.093.961 | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),11 20.626 | 75.902 | 57.835 | 68.823 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 — | — | — | 2.148 |
| Sonstige Erträge | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | 4.824.285 | 26.758.040 | 12.074.725 | 9.263.757 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 11.748 | — | 1.198 | 55.116 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 2.917.062 | 2.720.607 | 4.568 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 450.833 | — | — | 716.001 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) 321.084 | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 20.234.699 | 3.220.074 | 381.384 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 45.252 | 2.613.070 | 1.532.861 | 349.391 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 35.230 | 264.748 | 117.311 | 267.268 |
| Steuern | 8 26.882 | 448.498 | 256.401 | 77.705 |
| Performancegebühren | 7,16 — | 6.583.900 | 97.261 | — |
| Vertriebsgebühren | 4 32.125 | 158.962 | 373.579 | 428.417 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 590 | 10.748 | 3.905 | 2.491 |
| Verwaltungsgebühren | 4 170.789 | 16.935.355 | 6.964.899 | 2.834.661 |
| Sonstige Aufwendungen | — | 10.000 | 13.540 | 3.738 |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 1.094.533 | 50.177.042 | 15.301.636 | 5.120.740 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 — | — | — | 93 |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 1.094.533 | 50.177.042 | 15.301.636 | 5.120.647 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | 3.729.752 | (23.419.002) | (3.226.911) | 4.143.110 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) (4.863.726) | 12.294.943 | 60.372.591 | (20.058.976) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | 28.738.141 | 17.766.641 | 311.617 |
| Terminkontrakte | 2(d) 2.119.444 | — | — | 4.481.223 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (1.051.628) | (2.486.688) | 96.026 | 2.375.275 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) 874.347 | — | — | (4.149.904) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (6.764) | — | — | 104.910 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | (2.928.327) | 38.546.396 | 78.235.258 | (16.935.855) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) 1.329.550 | 7.039.601 | (40.145.305) | 4.167.913 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | 33.436.740 | 1.281.059 | 274.431 |
| Terminkontrakte | 2(d) (761.866) | — | — | (1.031.091) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (176.197) | 1.438.396 | 713.081 | (2.033.773) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) (1.068.061) | — | — | 2.579.835 |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (60.411) | — | — | 41.485 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | (736.985) | 41.914.737 | (38.151.165) | 3.998.800 |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | 64.440 | 57.042.131 | 36.857.182 | (8.793.945) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | 12.500.696 | 454.805.727 | 84.587.652 | 45.360.349 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | (25.015.312) | (675.619.343) | (119.040.547) | (105.920.412) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | (12.514.616) | (220.813.616) | (34.452.895) | (60.560.063) |
| Angekündigte Dividenden | 11 (86.727) | — | (1.009.659) | (216.603) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | 83.758.941 | 1.366.112.417 | 605.750.379 | 312.340.778 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Anmerkung | BlackRock European Unconstrained Equity Fund EUR | BlackRock Global Absolute Return Bond Fund EUR | BlackRock Global Equity Absolute Return Fund USD | BlackRock Global Event Driven Fund USD |
|---|----------------|--|---|---|--|
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | | 59.071.043 | 155.153.613 | 66.014.001 | 5.510.059.457 |
| Erträge | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | — | 124.717 | 37.248 | 20.553.015 |
| Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | — | 4.229.214 | 235.826 | 105.019.021 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | — | — | 474.154 | 6.338.948 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | 1.839.628 | — | 355.937 |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | 567.995 | 254.563 | 541.282 | 5.476.551 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | — | — | 102.474 | 16.987.532 |
| Wertpapierleihe | 2(c),11 | 4.050 | 39.586 | — | 980.727 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | — | 23.058 | — | — |
| Sonstige Erträge | | — | 56.577 | — | — |
| Gesamt Erträge | | 572.045 | 6.567.343 | 1.390.984 | 155.711.731 |
| Aufwendungen | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 30 | 34.987 | 722 | 185.446 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | — | 18 | 72.432 | 46.812.553 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | 1.676.843 | — | 6.266.392 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | — | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | — | — | 729.078 | 9.185.715 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 89.295 | 114.356 | 33.542 | 6.956.157 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 | 17.688 | 412.473 | 22.804 | 573.902 |
| Steuern | 8 | 15.000 | 25.019 | 6.120 | 1.124.482 |
| Performancegebühren | 7,16 | 311.225 | — | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 | 11.967 | 6.423 | 1.663 | 1.498.682 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 371 | 983 | 434 | 34.363 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 172.163 | 479.510 | 22.280 | 47.088.227 |
| Sonstige Aufwendungen | | — | — | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | | 617.739 | 2.750.612 | 889.075 | 119.725.919 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | — | 279.427 | 754 | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | | 617.739 | 2.471.185 | 888.321 | 119.725.919 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | (45.694) | 4.096.158 | 502.663 | 35.985.812 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | 1.739.886 | (9.244.370) | (3.877.695) | 53.931.360 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | (316.806) | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | 685 | 1.832.658 | (44.626.129) |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | 4.778.005 | (777.363) | 25.932.690 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | 754.010 | 1.013.109 | (2.503.481) | (10.703.188) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | (3.264.158) | — | 10.994.787 |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | 371.477 | — | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | 2.493.896 | (6.662.058) | (5.325.881) | 35.529.520 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | 5.883.189 | 373.483 | 5.159.731 | (44.535.542) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | (75.401) | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | (1.350) | 407.120 | (35.384.466) |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | (1.515.949) | 255.546 | (33.566.424) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | 56.144 | 377.685 | (93.549) | (138.500.590) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | 109.762 | — | (5.600.476) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | (428.024) | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | 5.939.333 | (1.159.794) | 5.728.848 | (257.587.498) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 8.387.535 | (3.725.694) | 905.630 | (186.072.166) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 10.732.565 | 14.151.026 | 3.344.539 | 795.663.922 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (20.469.643) | (70.094.844) | (36.199.477) | (2.680.050.886) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | (9.737.078) | (55.943.818) | (32.854.938) | (1.884.386.964) |
| Angekündigte Dividenden | 11 | — | (16.270) | — | — |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | 57.721.500 | 95.467.831 | 34.064.693 | 3.439.600.327 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Anmerkung | BlackRock Global Real Asset Securities Fund USD | BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative EUR | BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive EUR | BlackRock Managed Index Portfolios – Growth EUR |
|---|----------------|--|---|--|---|
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | | 825.278.731 | 92.812.104 | 158.057.000 | 444.803.756 |
| Erträge | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 1.445.534 | — | — | — |
| Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | — | — | — | — |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 4.026 | — | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | — | — | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | 25.769.417 | 502.422 | 1.179.624 | 1.370.714 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | 409.367 | — | — | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),11 | 65.728 | 1.363 | 3.853 | 29.034 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | — | 159.524 | 235.372 | 924.394 |
| Sonstige Erträge | | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | | 27.694.072 | 663.309 | 1.418.849 | 2.324.142 |
| Aufwendungen | | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 394.305 | 1.974 | 13.687 | 1.446 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | 228.947 | — | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | — | — | — |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | — | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | — | — | — | — |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 2.093.611 | 51.548 | 88.873 | 268.198 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 | 251.737 | 36.676 | 51.869 | 112.330 |
| Steuern | 8 | 411.708 | 40.223 | 70.560 | 215.544 |
| Performancegebühren | 7,16 | — | — | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 | 29.365 | 467 | 72 | 1.746 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 5.362 | 617 | 1.063 | 3.022 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 6.990.935 | 716.573 | 898.190 | 3.209.409 |
| Sonstige Aufwendungen | | — | — | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | | 10.405.970 | 848.078 | 1.124.314 | 3.811.695 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | — | 18.498 | 22.292 | 24.300 |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | | 10.405.970 | 829.580 | 1.102.022 | 3.787.395 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | 17.288.102 | (166.271) | 316.827 | (1.463.253) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | (60.121.885) | (1.314.332) | (3.503.290) | (20.294.318) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | 1.307.980 | — | — | — |
| Terminkontrakte | 2(d) | 6.798 | — | — | — |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (15.581.010) | 825.616 | 914.655 | 6.874.887 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | 10.846.117 | — | — | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | (63.542.000) | (488.716) | (2.588.635) | (13.419.431) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | (66.821.067) | (866.712) | (2.275.150) | 7.489.732 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | (1.223.961) | — | — | — |
| Terminkontrakte | 2(d) | — | — | — | — |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (3.492.754) | (1.336.856) | (941.040) | (5.191.060) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | 570.280 | — | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | (70.967.502) | (2.203.568) | (3.216.190) | 2.298.672 |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | (117.221.400) | (2.858.555) | (5.487.998) | (12.584.012) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 453.787.484 | 22.428.881 | 37.813.227 | 137.912.070 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (117.610.815) | (16.374.764) | (42.503.829) | (99.989.218) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | 336.176.669 | 6.054.117 | (4.690.602) | 37.922.852 |
| Angekündigte Dividenden | 11 | (73.661.908) | (28.365) | (114.246) | (18.907) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | 970.572.092 | 95.979.301 | 147.764.154 | 470.123.689 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | BlackRock Systematic Style Factor Fund ⁽¹⁾ | BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽²⁾ | BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽²⁾ |
|---|--|---|---|--|
| | EUR | USD | EUR | EUR |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 782.947.401 | 120.998.037 | 518.183.532 | 258.151.903 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) — | 131.245 | 66.229 | 33.720 |
| Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) — | 2.507.309 | 9.677.554 | 4.485.571 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 266.920 | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) — | 174.043 | 743.535 | 492.834 |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) 3.129.722 | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 2.598.615 | — | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),11 16.125 | — | 65.376 | 37.984 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 1.311.333 | — | — | — |
| Sonstige Erträge | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | 4.457.180 | 5.678.132 | 10.552.694 | 5.050.109 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 2.551 | — | 22.810 | 21.513 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 448.269 | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) — | 177.104 | 603.780 | 610.775 |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) — | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 2.533.940 | — | — |
| Jährliche Servicegebühr | 5 388.440 | 67.964 | 470.973 | 116.092 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 144.552 | 320.859 | 157.292 | 89.291 |
| Steuern | 8 293.748 | 14.539 | 139.439 | 26.580 |
| Performancegebühren | 7,16 — | — | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 536 | 6.254 | 130.911 | 20.509 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 4.884 | 862 | 3.686 | 1.682 |
| Verwaltungsgebühren | 4 4.434.900 | 491.122 | 1.630.805 | 589.782 |
| Sonstige Aufwendungen | — | — | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 5.269.611 | 4.060.913 | 3.159.696 | 1.476.224 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 14.083 | — | — | 47.651 |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 5.255.528 | 4.060.913 | 3.159.696 | 1.428.573 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | (798.348) | 1.617.219 | 7.392.998 | 3.621.536 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) (13.565.989) | (72.631) | (52.028.744) | (29.377.454) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | 3.230.937 | — | — |
| Terminkontrakte | 2(d) — | 593.679 | 2.310.587 | 2.193.958 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) 9.991.606 | 809.095 | 757.624 | 75.514 |
| Swap-Transaktionen | 2(d) — | 427.298 | (5.335.887) | (5.118.729) |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) — | — | (252.672) | (126.767) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | (3.574.383) | 4.988.378 | (54.549.092) | (32.353.478) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) (9.347.813) | 23.982 | 18.736.680 | 15.820.922 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | 2.199.575 | — | — |
| Terminkontrakte | 2(d) — | 2.921.860 | (133.873) | (1.134.261) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (7.110.735) | (5.274.018) | (649.403) | (191.115) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) — | (1.963.630) | 3.276.816 | 1.091.810 |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) — | — | (51.416) | (46.074) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | (16.458.548) | (2.092.231) | 21.178.804 | 15.541.282 |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | (20.831.279) | 4.513.366 | (25.977.290) | (13.190.660) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | 162.864.765 | 31.205.502 | 383.450.440 | 140.019.398 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | (276.301.627) | (37.020.661) | (211.856.522) | (158.961.851) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | (113.436.862) | (5.815.159) | 171.593.918 | (18.942.453) |
| Angekündigte Dividenden | 11 (70.639) | (59) | (49) | (54) |
| Wechselkursanpassung | 2(f) — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | 648.608.621 | 119.696.185 | 663.800.111 | 226.018.736 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| Anmerkung | BlackRock | BlackRock | BlackRock | BlackRock |
|---|--|--|---|--|
| | Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾ | Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽²⁾ | Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽²⁾ | BlackRock Systematic ESG World Equity Fund |
| | EUR | EUR | EUR | USD |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | 158.812.825 | 367.772.840 | 4.338.607.772 | 440.371.155 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 5.002 | 94.381 | 1.455.610 | 42.109 |
| Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) 1.695.588 | 8.075.684 | 88.228.413 | — |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 12.820 | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 169.444 | 1.335.499 | 36.931.544 | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) — | 177.192 | 999.607 | 7.416.540 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | — | — | — |
| Wertpapierleihe | 2(c),11 7.696 | 90.529 | 743.186 | 89.112 |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 — | 11.388 | 173.922 | — |
| Sonstige Erträge | — | — | — | — |
| Gesamt Erträge | 1.877.730 | 9.797.493 | 128.532.282 | 7.547.761 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) 19.626 | 51.460 | 917.962 | 1.797 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) — | 301 | — | — |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) 125.528 | 1.918.589 | 37.311.118 | — |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) 208.074 | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) — | 116.421 | — | — |
| Jährliche Servicegebühr | 5 151.003 | 199.006 | 5.292.450 | 431.518 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 76.609 | 138.299 | 824.507 | 105.579 |
| Steuern | 8 44.706 | 40.905 | 1.240.465 | 133.372 |
| Performancegebühren | 7,16 — | — | — | — |
| Vertriebsgebühren | 4 219 | 38.088 | 1.343.340 | 366.193 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 1.085 | 2.386 | 27.418 | 2.142 |
| Verwaltungsgebühren | 4 217.163 | 286.162 | 25.636.672 | 1.550.460 |
| Sonstige Aufwendungen | — | — | — | 388 |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | 844.013 | 2.791.617 | 72.593.932 | 2.591.449 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 194.205 | 44.709 | — | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | 649.808 | 2.746.908 | 72.593.932 | 2.591.449 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | 1.227.922 | 7.050.585 | 55.938.350 | 4.956.312 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) (6.056.335) | (42.080.091) | (316.160.722) | (11.751.283) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | (139.964) | — | — |
| Terminkontrakte | 2(d) 3.177.541 | 27.825.834 | 274.665.954 | 673.082 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) 218.570 | 650.952 | 47.337.196 | (10.028.934) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) (1.484.071) | (1.029.796) | (214.395.147) | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (81.521) | 727.509 | (6.695.531) | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | (4.225.816) | (14.045.556) | (215.248.250) | (21.107.135) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) 1.859.153 | 28.165.194 | 127.845.815 | 22.222.712 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) — | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) — | 124.509 | — | — |
| Terminkontrakte | 2(d) (1.237.739) | (14.052.400) | (55.473.922) | (204.961) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) (207.647) | (683.890) | (23.884.591) | (404.004) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) 1.079.697 | (1.705.709) | 117.400.218 | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) (13.670) | 375.837 | (479.701) | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | 1.479.794 | 12.223.541 | 165.407.819 | 21.613.747 |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | (1.518.100) | 5.228.570 | 6.097.919 | 5.462.924 |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | 9.450.323 | 17.767.724 | 906.274.917 | 170.616.933 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | (37.702.469) | (129.010.633) | (2.363.899.703) | (204.727.743) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | (28.252.146) | (111.242.909) | (1.457.624.786) | (34.110.810) |
| Angekündigte Dividenden | 11 — | (100) | (7.772.414) | — |
| Wechselkursanpassung | 2(f) — | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | 129.042.579 | 261.758.401 | 2.879.308.491 | 411.723.269 |

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Anmerkung | BlackRock | BlackRock | BlackRock UK |
|---|----------------|--|--|--------------------------------|
| | | Systematic Sustainable Global Equity Fund ⁽¹⁾ | Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | Equity Absolute Return Fund |
| | | USD | USD | GBP |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres | | 145.106.726 | 52.481.344 | 213.971.378 |
| Erträge | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 11.166 | 2.988 | 805.988 |
| Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | — | 1.165.403 | 4.472.877 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | — | 109.045 | 476.983 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | — | — |
| Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c) | 2.801.800 | — | 635.175 |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | — | 2.009.926 | 5.378.027 |
| Wertpapierleihe | 2(c),11 | 38.195 | — | — |
| Abschläge auf Verwaltungsgebühren | 4 | — | — | — |
| Sonstige Erträge | | — | — | — |
| Gesamt Erträge | | 2.851.161 | 3.287.362 | 11.769.050 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bankzinsen | 2(c) | 238 | 126 | 25.787 |
| Zinsen aus Differenzkontrakten | 2(c),2(d) | — | 520.004 | 3.566.856 |
| Swaps, Zinsen und Dividenden | 2(c) | — | — | — |
| Negativrendite aus Finanzvermögenswerten | 2(c) | — | — | — |
| Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern | 2(c),2(d) | — | 2.385.371 | 2.310.932 |
| Jährliche Servicegebühr | 5 | 72.882 | 114.653 | 110.654 |
| Verwahrstellengebühren | 2(i),6 | 71.957 | 979.238 | 51.592 |
| Steuern | 8 | 14.092 | 17.366 | 21.338 |
| Performancegebühren | 7,16 | — | — | 1.147.980 |
| Vertriebsgebühren | 4 | 11.713 | 34.120 | 3.683 |
| Bereitstellungsprovisionen für Darlehen | 14 | 1.008 | 271 | 1.479 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 369.112 | 570.575 | 1.632.902 |
| Sonstige Aufwendungen | | 632 | — | — |
| Gesamtkosten vor Rückvergütung | | 541.634 | 4.621.724 | 8.873.203 |
| Rückvergütung von Kosten | 4 | — | 927.172 | — |
| Gesamtkosten nach Rückvergütung | | 541.634 | 3.694.552 | 8.873.203 |
| Ordentlicher Ertrag/(Verlust) | | 2.309.527 | (407.190) | 2.895.847 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a),2(b) | (4.342.362) | (108.401) | (394.074) |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | 825.932 | 18.088.447 |
| Terminkontrakte | 2(d) | 108.220 | 98.748 | (4.354.501) |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (2.732.832) | (656.587) | (16.403.539) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | (62.724) | — |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtsjahr | | (6.966.974) | 96.968 | (3.063.667) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus: | | | | |
| Anlagevermögen | 2(a) | 6.440.913 | 73.059 | 264.232 |
| „To be announced“-Wertpapierkontrakte | 2(d) | — | — | — |
| Differenzkontrakte | 2(d) | — | 208.222 | (8.952.360) |
| Terminkontrakte | 2(d) | (56.388) | (23.838) | 4.860.327 |
| Devisen und Devisentermingeschäfte | 2(d),2(e),2(j) | (25.688) | (1.401.323) | (1.365.777) |
| Swap-Transaktionen | 2(d) | — | — | — |
| Optionen/Swaptionen-Kontrakte | 2(d) | — | — | — |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) im Geschäftsjahr | | 6.358.837 | (1.143.880) | (5.193.578) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 1.701.390 | (1.454.102) | (5.361.398) |
| Veränderungen des Anteilskapitals | | | | |
| Nettozahlungseingänge aus der Ausgabe von Anteilen | | 9.885.552 | 21.630.781 | 55.972.920 |
| Nettozahlungen resultierend aus dem Rückkauf von Anteilen | | (16.426.764) | (36.059.760) | (69.801.328) |
| Zunahme/(Abnahme) des Netto-Fondsvermögens aus Veränderungen des Anteilskapitals | | (6.541.212) | (14.428.979) | (13.828.408) |
| Angekündigte Dividenden | 11 | — | — | — |
| Wechselkursanpassung | 2(f) | — | — | — |
| Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | 140.266.904 | 36.598.263 | 194.781.572 |

⁽¹⁾Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Auf AUD lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | 149 | — | — | 149 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | 258 | 3.840 | 2.917 | 1.181 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 4.657.097 | 1.807.528 | 2.678.073 | 3.786.552 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 183.950 | 58.542 | 79.574 | 162.918 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1.221.488 | 148.660 | 377.647 | 992.501 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 33 | — | — | 33 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 143.423 | 198.945 | 214.667 | 127.701 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 2.068 | 230 | — | 2.298 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 477.448 | 359.928 | 517.162 | 320.214 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 133 | 1.065 | 1.197 | 1 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 47.424 | 10.039 | 27.414 | 30.049 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 574.771 | 369.817 | 259.930 | 684.658 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 3.449.334 | 1.209.796 | 841.781 | 3.817.349 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1.276.996 | — | 548.324 | 728.672 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 644.328 | 78.798 | 367.671 | 355.455 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 93.368 | 34.059 | 15.034 | 112.393 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | | | | |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 44 | 5.406 | 15 | 5.435 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | 2.821 | 5.868 | 3.051 | 5.638 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 41 | — | — | 41 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 13.057 | 44.430 | 31.940 | 25.547 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 589 | 2.759 | 2.201 | 1.147 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 48 | 20.444 | 2.276 | 18.216 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 3.815 | 4.400 | 164 | 8.051 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 23.141 | 50.059 | 33.154 | 40.046 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 6.555 | 5.453 | 2.578 | 9.430 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 272.819 | 55.514 | 119.398 | 208.935 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 43.932 | 103.353 | 12.485 | 134.800 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 3.238 | — | 3.190 | 48 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 339 | 106.123 | — | 106.462 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 100 | 240 | — | 340 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 94 | 3.793 | 401 | 3.486 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 100 | 14.397 | 4.172 | 10.325 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 47 | 8.461 | 69 | 8.439 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 7.214 | 11.116 | 2.228 | 16.102 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 164.635 | 11.794 | 2.091 | 174.338 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 37 | 70.802 | 6.769 | 64.070 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 94 | 5.430 | 736 | 4.788 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 10.143 | 71 | 10.074 | 140 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 63.963 | 196 | 63.822 | 337 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 138.289 | 34.319 | 66.087 | 106.521 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1.322.383 | 35.623 | 183.730 | 1.174.276 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 790.781 | 68.845 | 418.203 | 441.423 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 49.395 | 5.339 | 6.089 | 48.645 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1.241.916 | 25.395 | 489.071 | 778.240 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 5.224.818 | 464.399 | 1.528.539 | 4.160.678 |
| Auf CAD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 68 | — | — | 68 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 381.755 | — | 381.700 | 55 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 3.823 | — | 3.512 | 311 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 50 | 647.884 | 22.406 | 625.528 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 865.215 | 39.572 | 904.666 | 121 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | | | | |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 6.431 | — | 3.750 | 2.681 |
| Auf CNH lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 33 | — | — | 33 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 70.737 | 10.249 | 7.637 | 73.349 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 293.820 | 295 | 104.701 | 189.414 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 126.326 | 3.299 | 29.997 | 99.628 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 152.865 | 12.025 | 27.777 | 137.113 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 47.969 | 3.591 | 21.465 | 30.095 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 293.094 | 15.317 | 119.466 | 188.945 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 804.577 | 14.059 | 586.209 | 232.427 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 229.733 | 18.273 | 143.234 | 104.772 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 345.963 | 45.360 | 307.240 | 84.083 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 74.939 | 2.962 | 36.127 | 41.774 |
| Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 46.271 | 7.658 | 30.296 | 23.633 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 2.220 | 1.182 | 1.196 | 2.206 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 40.599 | 225 | 20.751 | 20.073 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1.870.886 | 65.834 | 619.313 | 1.317.407 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1.033.444 | 15.465 | 736.492 | 312.417 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 735.904 | 100.650 | 307.131 | 529.423 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 151.613 | 52.178 | 85.239 | 118.552 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 45 | — | — | 45 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 44.899 | — | 40.590 | 4.309 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 77.710 | — | 44.557 | 33.153 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 27.995 | — | 15.312 | 12.683 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 44.755 | — | 8.517 | 36.238 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 312.525 | 113.729 | 79.197 | 347.057 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 3.864 | 55 | 55 | 3.864 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | 50 | 1.642 | — | 1.692 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 26.134 | 3.758 | 3.818 | 26.074 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 110.498 | 20.637 | 20.525 | 110.610 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 393.841 | 112.096 | 64.161 | 441.776 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 132.276 | 83.276 | 32.541 | 183.011 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 194.122 | 40.227 | 97.816 | 136.533 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 210.159 | 55.983 | 58.338 | 207.804 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 364.757 | 208.013 | 116.169 | 456.601 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 301.457 | 197.019 | 48.490 | 449.986 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 22.264 | 67.612 | 15.654 | 74.222 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse Z | 441 | — | 102 | 339 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 275.205 | — | 80.979 | 194.226 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | | | | |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 30 | — | — | 30 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 41.691 | 1.116 | 7.298 | 35.509 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 9.508 | 4 | 2.923 | 6.589 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 3.502 | 5.891 | 8.864 | 529 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 51 | — | — | 51 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | 45 | — | — | 45 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 80.648 | 4.488 | 8.242 | 76.894 |
| Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 41 | — | — | 41 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 42 | — | — | 42 |
| Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 10.003 | 61 | 8.356 | 1.708 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 16.633 | 256 | 12.319 | 4.570 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 27.304 | 387 | 1.831 | 25.860 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 51 | — | — | 51 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 61.707 | 2.128 | 25.586 | 38.249 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 35.988 | 8.251 | 8.491 | 35.748 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 178.539 | 2.451 | 25.331 | 155.659 |
| Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse I | 10.052 | — | — | 10.052 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I | 154.937 | 3.519 | 40.000 | 118.456 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil (G) der Klasse I | 1.660 | — | — | 1.660 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 530 | — | — | 530 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 44 | — | — | 44 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1.750.130 | 1.777 | 174.392 | 1.577.515 |
| Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse X | 44 | — | — | 44 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 520.856 | 5 | 142.623 | 378.238 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 8.454.963 | — | — | 8.454.963 |
| Auf CAD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 2.370.126 | — | — | 2.370.126 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 18.841 | 15.989 | 6.997 | 27.833 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse AI | 45 | 952 | 260 | 737 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | 367 | 1.641 | 536 | 1.472 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 166.217 | 12.669 | 115.373 | 63.513 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 9.473 | 4.021 | 407 | 13.087 |
| Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse E | 12.436 | 5.846 | 3.284 | 14.998 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse E | 13.157 | 3.705 | 3.686 | 13.176 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 23.543 | 21.543 | 12.463 | 32.623 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 5.110 | 3.855 | 264 | 8.701 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I ⁽²⁾ | — | 50 | — | 50 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 182.043 | 41.949 | 33.973 | 190.019 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 445.437 | 924 | 56.338 | 390.023 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 179.698 | 9.273 | 34.907 | 154.064 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 2.873.617 | 223.896 | 939.001 | 2.158.512 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | 107.238 | 33.304 | 19.666 | 120.876 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 152.892 | 69.225 | 94.304 | 127.813 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1.496.105 | 264.012 | 624.903 | 1.135.214 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 45.779 | 13.344 | 16.079 | 43.044 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 110.180 | 23.918 | 28.600 | 105.498 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 246.516 | 9.883 | 62.380 | 194.019 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 4.481.422 | 2.046.232 | 2.340.087 | 4.187.567 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S | 145.838 | 75.053 | 99.420 | 121.471 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 225.627 | 126.850 | 79.470 | 273.007 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | | | | |
| Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 6.189 | 139 | 56 | 6.272 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 385.234 | 43.557 | 47.682 | 381.109 |
| Ausschüttender Anteil (G) der Klasse D | 473.018 | — | 1.816 | 471.202 |
| Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 7.650 | 387 | 3.795 | 4.242 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 274.832 | 55.926 | 86.235 | 244.523 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 166.343 | 3.111 | 26.067 | 143.387 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 262.262 | 92.368 | 123.928 | 230.702 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 37 | — | — | 37 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 51.853 | 4.111 | 11.980 | 43.984 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 112.208 | 5.804 | 22.939 | 95.073 |
| Auf CZK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 33.824 | 11 | 6.338 | 27.497 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 56.030 | 346 | 26.816 | 29.560 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D | 2.702 | — | 2.700 | 2 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 144.299 | 23.458 | 68.622 | 99.135 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse E | 311.711 | 1.884 | 84.658 | 228.937 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 658.211 | 7.597 | 113.333 | 552.475 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I | 144 | 105.000 | 1 | 105.143 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 2.272.588 | 291.647 | 698.259 | 1.865.976 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 43 | — | — | 43 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 2.670 | 23.755 | 3.146 | 23.279 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 114.684 | 18.242 | 19.256 | 113.670 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 10.049 | 3.032 | 1.548 | 11.533 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 16.656 | 3.372 | 4.433 | 15.595 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 29.563 | — | 29.513 | 50 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 22.755 | 10.840 | 270 | 33.325 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 45 | — | — | 45 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 148.714 | — | 61.918 | 86.796 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1.790 | 150 | 1.245 | 695 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 2.410 | 29 | 1.142 | 1.297 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 58.760 | 4.022 | 22.946 | 39.836 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D | 6.235 | 791 | 1.674 | 5.352 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 226.676 | 17.146 | 19.221 | 224.601 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 2 | — | — | 2 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 12.944 | 2.468 | 2.035 | 13.377 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 615.682 | 33.763 | 314.205 | 335.240 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 21.149 | — | 4.498 | 16.651 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 11.177 | 13.180 | 4.102 | 20.255 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 483.974 | 60.380 | 281.444 | 262.910 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 44 | 2 | — | 46 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 2.408 | 4 | 902 | 1.510 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 44 | — | — | 44 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 3.605 | 541 | 1.665 | 2.481 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 4.440 | — | — | 4.440 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 393.927 | 5.689 | 246.277 | 153.339 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 370.348 | 48.804 | 163.053 | 256.099 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 2.874 | — | — | 2.874 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 1.723 | — | 1.674 | 49 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 44 | — | — | 44 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 12.879 | — | 807 | 12.072 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Global Event Driven Fund | | | | |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 42.625 | 5.718 | 22.584 | 25.759 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1.806.034 | 118.672 | 708.123 | 1.216.583 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 95.063 | 4.208 | 22.308 | 76.963 |
| Auf HKD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 39 | — | — | 39 |
| Auf SGD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 34.679 | — | 12.171 | 22.508 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 4.933.508 | 547.053 | 2.835.387 | 2.645.174 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | 45 | — | — | 45 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 10.971 | 462 | 2.081 | 9.352 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 320.011 | 26.853 | 80.803 | 266.061 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 2.689.980 | 353.000 | 1.165.014 | 1.877.966 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 2.491.481 | 400.244 | 1.483.120 | 1.408.605 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1.949.297 | 464.198 | 679.977 | 1.733.518 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 785.894 | 296.735 | 440.279 | 642.350 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 1.796.508 | 164.477 | 603.582 | 1.357.403 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 177.311 | 4.583 | 105.968 | 75.926 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 808.279 | 721.681 | 1.440.709 | 89.251 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 5.304.702 | 648.606 | 1.435.552 | 4.517.756 |
| Auf BRL lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 1.072.313 | 32.757 | 775.359 | 329.711 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 745.481 | — | 460.653 | 284.828 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 4.050.373 | 548.568 | 2.228.181 | 2.370.760 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 188.283 | 97.216 | 143.403 | 142.096 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 11.661.267 | 1.691.391 | 7.074.576 | 6.278.082 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse IA | 504.838 | 425 | 11.543 | 493.720 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse IA | 839.560 | 96.034 | 216.537 | 719.057 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S | 13.958 | 6.845 | 10.090 | 10.713 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S | 515.149 | 45.295 | 247.088 | 313.356 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 150.147 | 74.728 | 58.078 | 166.797 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 52.432 | — | — | 52.432 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 100.462 | — | 10.005 | 90.457 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 148.354 | — | 11.391 | 136.963 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 199.839 | — | 623 | 199.216 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | | | | |
| Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 12.791 | 1.646 | 2.061 | 12.376 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 3.062.848 | 671.984 | 582.153 | 3.152.679 |
| Auf AUD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 68 | 1.293 | — | 1.361 |
| Auf CAD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 63 | — | — | 63 |
| Auf CNH lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 32 | 80.174 | 2.553 | 77.653 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 191.212 | 375.172 | 50.144 | 516.240 |
| Auf HKD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 233.300 | 265.069 | 19.262 | 479.107 |
| Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 391.747 | 211.643 | 65.844 | 537.546 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 336.284 | 25.083 | 59.192 | 302.175 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1.334 | 673 | 469 | 1.538 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 14.688 | 8.206 | 12.142 | 10.752 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | 4.342.015 | 3.566.686 | 439.831 | 7.468.870 |
| Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D ⁽²⁾ | — | 312.332 | — | 312.332 |
| Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 66.964 | 164.650 | 45.594 | 186.020 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 105.466 | 24.387 | 16.313 | 113.540 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 60.059 | 23.339 | 41.215 | 42.183 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I | 99.931 | 37.604 | 136.912 | 623 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | — | 11.787 | 4.988 | 6.799 |
| Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | — | 48 | — | 48 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | — | 1.519 | — | 1.519 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | — | 41 | — | 41 |
| Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽²⁾ | — | 69 | — | 69 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 57.675 | 11.368 | 22.892 | 46.151 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 35.009 | 9.277 | 12.967 | 31.319 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 27.013 | 1.511 | 8.940 | 19.584 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 486 | 18 | — | 504 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 113.171 | 171.918 | 21.082 | 264.007 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 65.107 | — | 254 | 64.853 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 10.473 | 1.743 | 1.680 | 10.536 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 37.975 | 2.992 | 7.334 | 33.633 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 29.774 | 21.742 | 2.110 | 49.406 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | 16.118 | 1.326 | 5.047 | 12.397 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 44.958 | 17.448 | 13.481 | 48.925 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 121.894 | 2.454 | 3.199 | 121.149 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 12.477 | 6.450 | 13.494 | 5.433 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 988 | — | — | 988 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽²⁾ | — | 130.059 | 487 | 129.572 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 55.547 | 24.909 | 8.233 | 72.223 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Balance | 551.902 | 3.598 | 103.810 | 451.690 |
| Vermögensanlage ⁹⁹ konservativ thesaurierender Anteil ⁽²⁾ | — | 5.600 | 485 | 5.115 |
| Vermögensstrategie Moderat - Ausgewogen ausschüttender Anteil | 1.250 | — | 1.115 | 135 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 197.891 | 1.813 | 54.270 | 145.434 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 14.147 | 503 | 3.304 | 11.346 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 116.131 | 24.229 | 42.082 | 98.278 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 94.730 | 4.611 | 18.674 | 80.667 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 117.826 | 15.255 | 21.061 | 112.020 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 4.953 | 16 | 1.265 | 3.704 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 220.942 | 75.485 | 37.487 | 258.940 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 16.996 | 832 | 1.825 | 16.003 |
| Auf PLN lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D ⁽²⁾ | — | 22 | — | 22 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 253.533 | 66.626 | 64.183 | 255.976 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 52.244 | 65.645 | 43.246 | 74.643 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 102.344 | 44.977 | 34.862 | 112.459 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 191 | 9 | 40 | 160 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽²⁾ | — | 14.701 | 51 | 14.650 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 41.053 | 28.266 | 32.870 | 36.449 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 57.216 | 791 | 10.349 | 47.658 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Substanz | 160.796 | 413 | 37.397 | 123.812 |
| Vermögensanlage ⁹⁹ defensiv thesaurierender Anteil ⁽²⁾ | — | 2.420 | 446 | 1.974 |
| Vermögensstrategie Defensiv ausschüttender Anteil | 9.045 | — | — | 9.045 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 50 | — | — | 50 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 704.656 | 54.243 | 199.323 | 559.576 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 16.429 | 13.578 | 1.982 | 28.025 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 209.084 | 51.836 | 28.696 | 232.224 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 409.578 | 120.376 | 108.287 | 421.667 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 346.885 | 47.949 | 26.557 | 368.277 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 3.837 | 1.039 | 1.218 | 3.658 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 29.259 | 35.589 | 21.503 | 43.345 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 14.388 | 2.172 | 5.010 | 11.550 |
| Auf PLN lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D ⁽²⁾ | — | 22 | — | 22 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 123.522 | 115.142 | 25.713 | 212.951 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 287.766 | 227.761 | 135.061 | 380.466 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 342.471 | 128.396 | 68.616 | 402.251 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 3.217 | 202 | 274 | 3.145 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽²⁾ | — | 58.690 | 132 | 58.558 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 71.856 | 41.725 | 12.640 | 100.941 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 21.857 | 6.175 | 1.976 | 26.056 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Chance | 470.949 | 14.694 | 58.846 | 426.797 |
| Vermögensanlage ⁹⁹ dynamisch thesaurierender Anteil ⁽²⁾ | — | 29.806 | 2.743 | 27.063 |
| Vermögensstrategie Wachstum ausschüttender Anteil | 29.450 | 7.030 | 8.285 | 28.195 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 43 | — | — | 43 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 798.245 | 23.498 | 185.553 | 636.190 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 19.214 | 37.370 | 19.452 | 37.132 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 327.837 | 138.253 | 86.007 | 380.083 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1.508.473 | 92.040 | 990.236 | 610.277 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 322.524 | 88.922 | 87.462 | 323.984 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 11.326 | 582 | 1.904 | 10.004 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 170.839 | 28.014 | 23.071 | 175.782 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 22.633 | 5.249 | 4.745 | 23.137 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 506.644 | 64.229 | 94.777 | 476.096 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 392.765 | 162.209 | 76.478 | 478.496 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 777.764 | 246.513 | 278.342 | 745.935 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 848 | 449 | (1) | 1.298 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I | 212.227 | 110.594 | 217.258 | 105.563 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 92.849 | 63.438 | 13.073 | 143.214 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 213.918 | 61.178 | 25.762 | 249.334 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Wachstum | 747.124 | 9.108 | 157.034 | 599.198 |
| IndexInvest Wachstum, auf CHF lautender, abgesicherter ausschüttender Anteil | 14.365 | 2.031 | 3.340 | 13.056 |
| Vermögensanlage99 progressiv thesaurierender Anteil ⁽²⁾ | — | 16.487 | 804 | 15.683 |
| Vermögensstrategie Ausgewogen ausschüttender Anteil | 17.730 | 4.320 | 825 | 21.225 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 50 | — | — | 50 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 6.808 | 472 | 900 | 6.380 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 23.305 | 134.821 | 3.380 | 154.746 |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 622 | 4.988 | 3.420 | 2.190 |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 1.768 | 6.357 | 683 | 7.442 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 7.465 | 8.378 | 9.541 | 6.302 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 45 | 562 | 385 | 222 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 440 | — | — | 440 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 5.299 | — | — | 5.299 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 480 | 16.244 | 15.012 | 1.712 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 6.282 | 21.538 | 19.161 | 8.659 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 25.604 | 1.489 | 1.752 | 25.341 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 2.222 | 6.489 | 6.660 | 2.051 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 3.448 | 18.349 | 12.427 | 9.370 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 2.148 | 14.437 | 3.903 | 12.682 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil PF der Klasse I | 50 | — | — | 50 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil PF der Klasse I | 45 | — | — | 45 |
| Auf BRL lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 50 | — | — | 50 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 48 | — | — | 48 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 50 | — | — | 50 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 185 | — | 69 | 116 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 4.104 | — | 1.381 | 2.723 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1.266.232 | 161.366 | 214.378 | 1.213.220 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 2.671 | 1.046 | 1.810 | 1.907 |
| Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 489.869 | 195.555 | 231.027 | 454.397 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 42 | — | — | 42 |
| Auf NZD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 2 | — | — | 2 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 35 | — | — | 35 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 50 | — | — | 50 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 46 | — | — | 46 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|--|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund⁽³⁾ | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 160.949 | 101.815 | 73.809 | 188.955 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 50.932 | 155.892 | 8.702 | 198.122 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 585 | 1.057 | 446 | 1.196 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 533.812 | 1.019.214 | 1.147.581 | 405.445 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 323.171 | 36.384 | 64.492 | 295.063 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 2.052.211 | 606.645 | 327.577 | 2.331.279 |
| Ausschüttender Anteil (G) der Klasse X | 12.405 | — | 12.364 | 41 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 1.534.547 | 109.016 | 199.117 | 1.444.446 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 758.296 | — | 3.879 | 754.417 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽²⁾ | — | 2.039.955 | 470.500 | 1.569.455 |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund⁽³⁾ | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 47 | 103.956 | 2.054 | 101.949 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 27.453 | 12.782 | 6.068 | 34.167 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 1.740 | — | — | 1.740 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | 41 | — | — | 41 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 42.972 | 93.825 | 52.196 | 84.601 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 48.713 | 11.983 | 9.429 | 51.267 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 2.115.020 | 311.073 | 1.653.975 | 772.118 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 44 | — | — | 44 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 498.403 | 425.937 | 79.687 | 844.653 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽²⁾ | — | 521.587 | 3.184 | 518.403 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund⁽³⁾ | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 42 | 55.856 | 1.368 | 54.530 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 42 | 547 | 547 | 42 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 35.946 | 6.305 | 36.515 | 5.736 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 239 | 3.587 | 507 | 3.319 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 235.561 | 2.571 | 220.501 | 17.631 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 653.504 | 30.100 | 137.758 | 545.846 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 720.772 | 300 | 1.215 | 719.857 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽²⁾ | — | 49 | — | 49 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund⁽³⁾ | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 50 | — | — | 50 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 50 | 15 | — | 65 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 247.343 | 12.136 | 58.084 | 201.395 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | 50 | 21 | 9 | 62 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 1.050 | 2.010 | 3 | 3.057 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 89.891 | 19.153 | 39.430 | 69.614 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 50 | — | — | 50 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 3.312.026 | 144.423 | 1.185.119 | 2.271.330 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund⁽³⁾ | | | | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse A | 2.149.974 | 111.291 | 760.601 | 1.500.664 |
| Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 80.437 | 825 | 44.871 | 36.391 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 18.225 | 334 | 9.897 | 8.662 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 590.129 | 6.808 | 127.014 | 469.923 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 56 | — | — | 56 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 384.560 | 27.001 | 111.291 | 300.270 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 10.942.603 | 2.008.634 | 6.874.421 | 6.076.816 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 28.655 | 1.850 | 6.131 | 24.374 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 24.709 | 29.495 | 15.774 | 38.430 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | 1.068.861 | 75.771 | 198.807 | 945.825 |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 11.161 | — | 935 | 10.226 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 16.525 | 1.016 | 13.075 | 4.466 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 369.902 | 36.922 | 126.859 | 279.965 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 314.315 | 130.707 | 116.778 | 328.244 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 5.075.015 | 932.068 | 3.029.604 | 2.977.479 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 12.667 | 49.849 | 20.539 | 41.977 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 2.540.601 | 175.819 | 579.489 | 2.136.931 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I | 292.574 | 85.485 | 128.778 | 249.281 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 7.613.333 | 3.204.240 | 5.750.835 | 5.066.738 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 624.091 | 275.439 | 221.514 | 678.016 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse S ⁽²⁾ | — | 47 | — | 47 |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S ⁽²⁾ | — | 50 | — | 50 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S | 46 | 37.929 | 21.385 | 16.590 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S | 50 | 1.099 | 1.099 | 50 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse X | 2.209.021 | — | — | 2.209.021 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 1.739.361 | 91.189 | 1.025.843 | 804.707 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 69.852 | 37.149 | 28.872 | 78.129 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 591.917 | 556.085 | 309.275 | 838.727 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 309.588 | 180.116 | 67.485 | 422.219 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 49 | — | — | 49 |
| Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 343.730 | 84.979 | 1 | 428.708 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 53.912 | 6.665 | — | 60.577 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 562.892 | — | 433.500 | 129.392 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 2.449 | 315 | 449 | 2.315 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 226 | — | 131 | 95 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 10.336 | 1.556 | 1.608 | 10.284 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 3.041 | 873 | 854 | 3.060 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 624.866 | 52.816 | 96.461 | 581.221 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 925 | — | 419 | 506 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 3.614 | 662 | 488 | 3.788 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | 207.585 | — | — | 207.585 |
| Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | 42.945 | 5.348 | 6.489 | 41.804 |
| Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | 56 | — | — | 56 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Mitteilung über Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile

für das am 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr Fortsetzung

| | Im Umlauf befindliche Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Im Umlauf befindliche Anteile am Ende des Geschäftsjahres |
|---|---|------------------------|----------------------------|---|
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund⁽¹⁾ | | | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | 15.649 | 1.767 | 1.803 | 15.613 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 40.814 | 108 | 1.218 | 39.704 |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 755 | 318 | 130 | 943 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | 45 | 532 | 532 | 45 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse C | 529 | — | — | 529 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 38.548 | 74.684 | 61.470 | 51.762 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 291.701 | 123.353 | 263.293 | 151.761 |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 2.980 | 333 | 934 | 2.379 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 79.183 | 10.284 | 26.951 | 62.516 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 44 | — | — | 44 |
| Ausschüttender Anteil der Klasse J | 27.504 | — | 3.159 | 24.345 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 5.259 | 275 | 4.496 | 1.038 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | | | | |
| Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 45 | — | — | 45 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 45 | — | — | 45 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 53 | 350 | — | 403 |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 49 | — | — | 49 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 119 | — | — | 119 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 91 | 318 | 318 | 91 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 50 | 28 | — | 78 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 39 | 1.009 | — | 1.048 |
| Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 1.936 | 960 | 861 | 2.035 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 1.715 | 6.515 | 1.389 | 6.841 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 324.447 | 10.034 | 271.101 | 63.380 |
| Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 2.465.437 | 740.462 | 566.738 | 2.639.161 |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 97.825 | 25.970 | 36.075 | 87.720 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 7.255 | — | 7.218 | 37 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Auflegung einer neuen Anteilsklasse, nähere Informationen sind Anhang I zu entnehmen.

⁽³⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIE & WARRANTS | | | | | | | |
| Kaimaninseln | | | | | | | |
| 30.454 | Apollo Strategic Growth Capital II (Wts 31/12/2027) | 5.482 | 0,00 | | | | |
| | | 5.482 | 0,00 | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| 12.456 | ACELYRIN Inc | 224.208 | 0,03 | | | | |
| 2.480 | SentinelOne Inc 'A' | 52.625 | 0,01 | | | | |
| | | 276.833 | 0,04 | | | | |
| Gesamt Stammaktien & Warrants | | 282.315 | 0,04 | | | | |
| ANLEIHEN | | | | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| USD 10.500.000 | Federal Farm Credit Discount Notes 5/10/2023 (Zero Coupon) | 10.315.517 | 1,50 | | | | |
| USD 19.650.000 | United States Treasury Bill 29/8/2023 (Zero Coupon) | 19.405.638 | 2,82 | | | | |
| USD 300.000 | United States Treasury Bill 31/8/2023 (Zero Coupon) | 296.316 | 0,04 | | | | |
| USD 19.250.000 | United States Treasury Bill 7/9/2023 (Zero Coupon) | 18.998.467 | 2,76 | | | | |
| USD 12.400.000 | United States Treasury Bill 14/9/2023 (Zero Coupon) | 12.230.378 | 1,77 | | | | |
| USD 25.500.000 | United States Treasury Bill 19/9/2023 (Zero Coupon) | 25.093.286 | 3,64 | | | | |
| USD 17.815.000 | United States Treasury Bill 26/9/2023 (Zero Coupon) | 17.510.808 | 2,54 | | | | |
| USD 39.900.000 | United States Treasury Bill 12/10/2023 (Zero Coupon) | 39.188.178 | 5,69 | | | | |
| USD 9.225.000 | United States Treasury Bill 24/11/2023 (Zero Coupon) | 8.991.157 | 1,30 | | | | |
| USD 21.895.000 | United States Treasury Bill 30/11/2023 (Zero Coupon) | 21.395.440 | 3,11 | | | | |
| USD 5.610.000 | United States Treasury Bill 18/4/2024 (Zero Coupon) | 5.382.692 | 0,78 | | | | |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 16/5/2024 (Zero Coupon) | 4.775.879 | 0,69 | | | | |
| USD 22.700.000 | United States Treasury Floating Rate Note FRN 31/10/2023 | 22.701.228 | 3,30 | | | | |
| USD 15.000.000 | United States Treasury Note/Bond 1,50% 29/2/2024 | 14.583.343 | 2,12 | | | | |
| USD 12.000.000 | United States Treasury Note/Bond 2,25% 31/3/2024 | 11.706.097 | 1,70 | | | | |
| | | 232.574.424 | 33,76 | | | | |
| Gesamt Anleihen | | 232.574.424 | 33,76 | | | | |
| EINLAGENZERTIFIKATE | | | | | | | |
| Kanada | | | | | | | |
| USD 5.000.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 29/1/2024 | 5.000.000 | 0,73 | | | | |
| | | 5.000.000 | 0,73 | | | | |
| Frankreich | | | | | | | |
| USD 5.000.000 | BNP Paribas SA FRN 16/11/2023 | 5.000.000 | 0,72 | | | | |
| USD 7.500.000 | Credit Industriel Et Commercial SA FRN 10/7/2023 | 7.500.320 | 1,09 | | | | |
| | | 12.500.320 | 1,81 | | | | |
| | | | | Japan | | | |
| USD 5.000.000 | Mizuho Bank Ltd FRN 21/2/2024 | 5.000.000 | 0,73 | | | | |
| | | 5.000.000 | 0,73 | | | | |
| | | | | Großbritannien | | | |
| USD 7.500.000 | Oversea Chinese Banking Corporation FRN 14/7/2023 | 7.498.838 | 1,09 | | | | |
| | | 7.498.838 | 1,09 | | | | |
| | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 4.510.000 | Bank of America NA FRN 14/7/2023 | 4.510.000 | 0,65 | | | | |
| USD 6.000.000 | Natixis SA FRN 2/2/2024 | 6.000.000 | 0,87 | | | | |
| | | 10.510.000 | 1,52 | | | | |
| Gesamt Einlagezertifikate | | 40.509.158 | 5,88 | | | | |
| | | | | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| | | | | Australien | | | |
| USD 5.000.000 | Commonwealth Bank of Australia FRN 16/2/2024 | 5.000.000 | 0,73 | | | | |
| USD 5.000.000 | National Australia Bank Ltd 1/6/2023 (Zero Coupon) | 5.000.000 | 0,73 | | | | |
| USD 10.000.000 | National Australia Bank Ltd FRN 13/7/2023 | 10.000.000 | 1,45 | | | | |
| USD 6.000.000 | Westpac Banking Corp 30/8/2023 (Zero Coupon) | 5.938.950 | 0,86 | | | | |
| | | 25.938.950 | 3,77 | | | | |
| | | | | Kanada | | | |
| USD 5.000.000 | Bank of Montreal FRN 6/10/2023 | 4.997.201 | 0,73 | | | | |
| USD 5.000.000 | CDP Financial Inc 1/11/2023 (Zero Coupon) | 4.894.388 | 0,71 | | | | |
| USD 9.200.000 | Export Development Canada 9/6/2023 (Zero Coupon) | 9.190.391 | 1,33 | | | | |
| USD 9.650.000 | National Bank of Canada 14/7/2023 (Zero Coupon) | 9.590.697 | 1,39 | | | | |
| USD 7.000.000 | Podium Funding Trust 25/7/2023 (Zero Coupon) | 6.947.815 | 1,01 | | | | |
| USD 7.500.000 | Podium Funding Trust 1/11/2023 (Zero Coupon) | 7.331.062 | 1,07 | | | | |
| | | 42.951.554 | 6,24 | | | | |
| | | | | Frankreich | | | |
| USD 10.500.000 | Antalis SA 12/6/2023 (Zero Coupon) | 10.483.798 | 1,52 | | | | |
| USD 3.500.000 | Antalis SA 1/8/2023 (Zero Coupon) | 3.470.525 | 0,50 | | | | |
| USD 8.600.000 | BPCE SA 1/8/2023 (Zero Coupon) | 8.528.013 | 1,24 | | | | |
| | | 22.482.336 | 3,26 | | | | |
| | | | | Luxemburg | | | |
| USD 10.000.000 | Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 23/6/2023 (Zero Coupon) | 9.969.139 | 1,45 | | | | |
| USD 7.350.000 | Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 11/8/2023 (Zero Coupon) | 7.280.710 | 1,05 | | | | |
| | | 17.249.849 | 2,50 | | | | |
| | | | | Südafrika | | | |
| USD 10.000.000 | KFW International Finance Inc 20/7/2023 (Zero Coupon) | 9.931.945 | 1,44 | | | | |
| | | 9.931.945 | 1,44 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| | Spanien | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| USD 5.000.000 | Banco Santander SA 4/10/2023 (Zero Coupon) | 4.910.417 | 0,71 | USD 7.500.000 | Old Line Funding LLC 11/7/2023 (Zero Coupon) | 7.458.750 | 1,08 |
| | | 4.910.417 | 0,71 | USD 17.500.000 | Old Line Funding LLC 4/12/2023 (Zero Coupon) | 16.999.092 | 2,47 |
| | Schweden | | | USD 13.100.000 | Pacific Life Insurance Co 21/6/2023 (Zero Coupon) | 13.062.592 | 1,90 |
| USD 7.500.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 13/7/2023 | 7.500.000 | 1,09 | USD 8.750.000 | Ridgefield Funding Co LLC 2/8/2023 (Zero Coupon) | 8.675.858 | 1,26 |
| USD 5.000.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 28/7/2023 | 5.000.000 | 0,73 | USD 9.500.000 | Royal Bank of Canada 20/6/2023 (Zero Coupon) | 9.475.181 | 1,38 |
| | | 12.500.000 | 1,82 | USD 14.000.000 | Siemens Capital Co LLC 30/6/2023 (Zero Coupon) | 13.943.837 | 2,02 |
| | Großbritannien | | | USD 4.500.000 | Societe Generale SA FRN 17/11/2023 | 4.500.000 | 0,65 |
| USD 13.250.000 | Lloyds Bank Plc 2/8/2023 (Zero Coupon) | 13.135.903 | 1,91 | USD 6.500.000 | Suncorp Metway Ltd 6/6/2023 (Zero Coupon) | 6.495.613 | 0,94 |
| | | 13.135.903 | 1,91 | USD 7.000.000 | Toyota Motor Credit Corp 5/7/2023 (Zero Coupon) | 6.968.597 | 1,01 |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | | USD 10.000.000 | United Overseas Bank Ltd 28/7/2023 (Zero Coupon) | 9.917.667 | 1,44 |
| USD 5.000.000 | Alinghi Funding Co LLC 13/7/2023 (Zero Coupon) | 4.970.425 | 0,72 | | | 301.181.606 | 43,72 |
| USD 5.000.000 | Amazon.com Inc 28/6/2023 (Zero Coupon) | 4.982.000 | 0,72 | Gesamt kurzfristige Titel | | 450.282.560 | 65,37 |
| USD 10.000.000 | Amazon.com Inc 17/7/2023 (Zero Coupon) | 9.937.644 | 1,44 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 723.648.457 | 105,05 |
| USD 15.750.000 | Chariot Funding LLC 14/6/2023 (Zero Coupon) | 15.722.472 | 2,28 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 723.648.457 | 105,05 |
| USD 5.000.000 | Charta LLC 16/6/2023 (Zero Coupon) | 4.989.708 | 0,73 | Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | (34.780.398) | (5,05) |
| USD 7.125.000 | Ciesco LLC 5/6/2023 (Zero Coupon) | 7.120.978 | 1,03 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 688.868.059 | 100,00 |
| USD 1.500.000 | Columbia Funding Company LLC 5/6/2023 (Zero Coupon) | 1.499.221 | 0,22 | | | | |
| USD 5.723.000 | Cooperatieve Rabobank UA 25/9/2023 (Zero Coupon) | 5.631.534 | 0,82 | | | | |
| USD 9.950.000 | Cooperatieve Rabobank UA 2/10/2023 (Zero Coupon) | 9.784.100 | 1,42 | | | | |
| USD 10.000.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec 28/8/2023 (Zero Coupon) | 9.874.600 | 1,43 | | | | |
| USD 2.750.000 | GTA Funding LLC 10/7/2023 (Zero Coupon) | 2.734.687 | 0,40 | | | | |
| USD 9.500.000 | GTA Funding LLC 4/8/2023 (Zero Coupon) | 9.411.840 | 1,37 | | | | |
| USD 12.000.000 | ING US Funding LLC 1/9/2023 (Zero Coupon) | 11.850.653 | 1,72 | | | | |
| USD 4.400.000 | ING US Funding LLC 25/9/2023 (Zero Coupon) | 4.329.962 | 0,63 | | | | |
| USD 12.100.000 | John Deere Capital Corp 22/6/2023 (Zero Coupon) | 12.064.708 | 1,75 | | | | |
| USD 5.000.000 | John Deere Capital Corp 7/8/2023 (Zero Coupon) | 4.952.356 | 0,72 | | | | |
| USD 7.520.000 | Johnson & Johnson 13/7/2023 (Zero Coupon) | 7.477.713 | 1,09 | | | | |
| USD 7.500.000 | Linde Plc 5/7/2023 (Zero Coupon) | 7.464.088 | 1,08 | | | | |
| USD 5.200.000 | L'Oreal SA 7/6/2023 (Zero Coupon) | 5.195.840 | 0,75 | | | | |
| USD 13.800.000 | L'Oreal SA 24/8/2023 (Zero Coupon) | 13.632.238 | 1,98 | | | | |
| USD 9.750.000 | Macquarie Bank Ltd FRN 22/6/2023 | 9.750.000 | 1,42 | | | | |
| USD 9.600.000 | Niederlandse Waterschapsbank NV 1/6/2023 (Zero Coupon) | 9.600.000 | 1,39 | | | | |
| USD 15.600.000 | Niederlandse Waterschapsbank NV 19/7/2023 (Zero Coupon) | 15.493.920 | 2,25 | | | | |
| USD 6.100.000 | Nestle Finance International Ltd 29/9/2023 (Zero Coupon) | 5.996.300 | 0,87 | | | | |
| USD 9.250.000 | Oesterreichische Kontrollbank AG 26/6/2023 (Zero Coupon) | 9.217.432 | 1,34 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------------------|--|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | 6.198 | 4D Molecular Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 5.663 |
| Brasilien | | | | (2.693) | 5E Advanced Materials Inc | HSBC | 4.901 |
| 13.100 | Agrenco Ltd BDR* | Morgan Stanley | — | (46.503) | 5E Advanced Materials Inc | Morgan Stanley | 13.021 |
| (3) | Banco ABC Brasil SA (Pref) | Morgan Stanley | 1 | 5.599 | 8x8 Inc | Bank of America | |
| | | | 1 | | | Merrill Lynch | 4.031 |
| Kanada | | | | 24.732 | 8x8 Inc | Barclays Bank | 4.204 |
| 21.785 | Perpetua Resources Corp | Bank of America | (14.378) | 94.209 | 8x8 Inc | HSBC | 97.670 |
| | | Merrill Lynch | (13.097) | 7.067 | 8x8 Inc | Morgan Stanley | 1.201 |
| 31.184 | Perpetua Resources Corp | Barclays Bank | (13.096) | (26.447) | 908 Devices Inc | Barclays Bank | (2.512) |
| 19.842 | Perpetua Resources Corp | Goldman Sachs | (13.096) | (10.009) | 908 Devices Inc | Morgan Stanley | (951) |
| 24.588 | Perpetua Resources Corp | HSBC | (21.883) | 11.305 | A O Smith Corp | Bank of America | |
| 12.571 | Perpetua Resources Corp | Morgan Stanley | (5.280) | | | Merrill Lynch | (34.367) |
| (26.058) | Poseidon Concepts Corp* | Morgan Stanley | 5.211 | 18.427 | A O Smith Corp | Barclays Bank | (55.834) |
| 12.100 | Sears Canada Inc* | Morgan Stanley | (5.557) | 1.728 | A O Smith Corp | Goldman Sachs | (5.253) |
| | | | (68.080) | 18.129 | A O Smith Corp | HSBC | (81.848) |
| Kaimaninseln | | | | 11.803 | A O Smith Corp | Morgan Stanley | (35.763) |
| (27.864) | SMART Global Holdings Inc | Goldman Sachs | (159.382) | 17.395 | A10 Networks Inc | Barclays Bank | 13.481 |
| (18.315) | SMART Global Holdings Inc | HSBC | (116.483) | 12.598 | A10 Networks Inc | Morgan Stanley | 9.763 |
| | | | (275.865) | 6.500 | AAON Inc | Barclays Bank | (22.100) |
| Mexiko | | | | (11.181) | AAR Corp | Goldman Sachs | 25.381 |
| 12.916 | Prologis Property Mexico SA de CV (REIT) | Goldman Sachs | — | (4.708) | AAR Corp | HSBC | 7.957 |
| | | | — | (1.986) | AAR Corp | Morgan Stanley | 6.236 |
| Peru | | | | 27.372 | Aaron's Co Inc | Barclays Bank | (12.865) |
| 7.452 | Tahoe Resources Inc | Morgan Stanley | (75) | 10.311 | Aaron's Co Inc | HSBC | (722) |
| | | | (75) | 13.043 | Aaron's Co Inc | Morgan Stanley | (6.130) |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | 9.945 | Abbott Laboratories | Bank of America | |
| (696) | 10X Genomics Inc 'A' | Bank of America | 64 | 476 | Abbott Laboratories | Merrill Lynch | (88.113) |
| (5.444) | 10X Genomics Inc 'A' | Merrill Lynch | 21.123 | 7.277 | Abbott Laboratories | Goldman Sachs | (4.218) |
| (2.624) | 10X Genomics Inc 'A' | Barclays Bank | 1.548 | 4.310 | Abbott Laboratories | HSBC | (72.188) |
| (2.834) | 10X Genomics Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.878 | (472) | AbbVie Inc | Morgan Stanley | (31.334) |
| 19.495 | 1-800-Flowers.com Inc 'A' | HSBC | (23.979) | (1.477) | AbbVie Inc | Barclays Bank | 4.215 |
| 9.512 | 1-800-Flowers.com Inc 'A' | Barclays Bank | 2.663 | 17.212 | AbCellera Biologics Inc | Goldman Sachs | 15.686 |
| 3.537 | 1st Source Corp | HSBC | (495) | 13.900 | AbCellera Biologics Inc | Barclays Bank | 6.368 |
| 1.003 | 1st Source Corp | Goldman Sachs | 522 | 4.562 | Abercrombie & Fitch Co 'A' | HSBC | 17.653 |
| 21.676 | 1st Source Corp | HSBC | 14.089 | 3.907 | Abercrombie & Fitch Co 'A' | Bank of America | |
| (1.493) | 1stdibs.com Inc | Barclays Bank | (75) | 7.310 | Abercrombie & Fitch Co 'A' | Merrill Lynch | 31.478 |
| (1.086) | 1stdibs.com Inc | Goldman Sachs | 33 | 7.310 | Abercrombie & Fitch Co 'A' | Barclays Bank | 33.561 |
| (7.335) | 1stdibs.com Inc | HSBC | 2.127 | (765) | ABIOMED Inc* | Morgan Stanley | 62.793 |
| (28.594) | 1stdibs.com Inc | Morgan Stanley | (1.430) | (3.054) | ABIOMED Inc* | Barclays Bank | (2.157) |
| (22.054) | 23andMe Holding Co 'A' | HSBC | 4.852 | (36.374) | ABM Industries Inc | Goldman Sachs | (5.497) |
| (45.909) | 23andMe Holding Co 'A' | Morgan Stanley | 5.509 | (7.257) | ABM Industries Inc | Barclays Bank | (28.372) |
| 8.250 | 2seventy bio Inc | Bank of America | | 7.579 | Absci Corp | HSBC | (14.151) |
| | | Merrill Lynch | 1.403 | 8.262 | Absci Corp | HSBC | 3.638 |
| 3.035 | 2seventy bio Inc | Barclays Bank | 819 | (26.484) | Acacia Research Corp | Morgan Stanley | 744 |
| 2.041 | 2seventy bio Inc | Goldman Sachs | 347 | (55.272) | Acacia Research Corp | Bank of America | 1.854 |
| 9.031 | 2seventy bio Inc | HSBC | 4.606 | (30.709) | Acacia Research Corp | Merrill Lynch | 553 |
| 6.849 | 2seventy bio Inc | Morgan Stanley | 1.849 | (47.759) | Acacia Research Corp | Goldman Sachs | 2.150 |
| 6.033 | 2U Inc | Bank of America | | (33.060) | Acacia Research Corp | HSBC | — |
| | | Merrill Lynch | (482) | 738 | Academy Sports & Outdoors Inc | Morgan Stanley | 331 |
| 22.723 | 2U Inc | Barclays Bank | (7.953) | (13.739) | Academy Sports & Outdoors Inc | Bank of America | (7.621) |
| 455 | 2U Inc | Goldman Sachs | (36) | 732 | Academy Sports & Outdoors Inc | Merrill Lynch | 1.854 |
| 388 | 2U Inc | HSBC | 8 | 3.353 | Academy Sports & Outdoors Inc | Barclays Bank | 68.695 |
| 6.031 | 2U Inc | Morgan Stanley | (2.111) | 13.718 | Academy Sports & Outdoors Inc | Goldman Sachs | (3.467) |
| (7.471) | 3D Systems Corp | Bank of America | | 13.718 | Academy Sports & Outdoors Inc | HSBC | (21.004) |
| | | Merrill Lynch | 358 | (2.258) | Acadia Healthcare Co Inc | Morgan Stanley | (67.513) |
| (24.009) | 3D Systems Corp | Barclays Bank | 6.723 | (6.361) | Acadia Healthcare Co Inc | Bank of America | |
| (71.687) | 3D Systems Corp | Goldman Sachs | 15.054 | 3.656 | Acadia Healthcare Co Inc | Merrill Lynch | 7.339 |
| (59.122) | 3D Systems Corp | HSBC | 56.757 | 2.617 | Acadia Healthcare Co Inc | Barclays Bank | 25.635 |
| (23.999) | 3D Systems Corp | Morgan Stanley | 2.348 | (15.966) | Acadia Healthcare Co Inc | Barclays Bank | (14.734) |
| (39.377) | 3M Co | Barclays Bank | 283.120 | 4.770 | Acadia Healthcare Co Inc | Goldman Sachs | (8.505) |
| (7.413) | 3M Co | Goldman Sachs | 44.256 | | | HSBC | 5.588 |
| (10.194) | 3M Co | HSBC | 79.717 | | | HSBC | (1.670) |
| (5.827) | 3M Co | Morgan Stanley | 41.896 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (7.030) | ACADIA Pharmaceuticals Inc | HSBC | (18.137) | 885 | Adams Resources & Energy Inc | Barclays Bank | (434) |
| (1.424) | ACADIA Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 1.996 | 945 | Adams Resources & Energy Inc | Goldman Sachs | 926 |
| 10.858 | Acadia Realty Trust (REIT) | Bank of America | | 6.193 | Adams Resources & Energy Inc | HSBC | (27.001) |
| 41.400 | Acadia Realty Trust (REIT) | Merrill Lynch | (7.166) | 3.148 | Adams Resources & Energy Inc | | |
| 32.707 | Acadia Realty Trust (REIT) | Barclays Bank | (12.006) | (11.695) | AdaptHealth Corp | Morgan Stanley | (1.543) |
| 85.359 | Acadia Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | (21.587) | (1.667) | AdaptHealth Corp | Bank of America | |
| 14.498 | Acadia Realty Trust (REIT) | HSBC | (56.337) | (5.609) | AdaptHealth Corp | Merrill Lynch | 8.187 |
| 4.969 | Accel Entertainment Inc | Morgan Stanley | (4.204) | 7.376 | Adaptive Biotechnologies Corp | HSBC | 2.767 |
| 41.867 | Accel Entertainment Inc | Bank of America | | (5.609) | Adaptive Biotechnologies Corp | Morgan Stanley | 5.329 |
| 21.191 | Accel Entertainment Inc | Merrill Lynch | (1.342) | 7.376 | Adaptive Biotechnologies Corp | Bank of America | |
| 15.519 | Accel Entertainment Inc | Barclays Bank | (14.235) | 88.712 | Adaptive Biotechnologies Corp | Merrill Lynch | 3.614 |
| 12.296 | Accel Entertainment Inc | Goldman Sachs | (5.722) | 17.451 | Adaptive Biotechnologies Corp | Barclays Bank | 54.114 |
| 1.095 | Accenture Plc 'A' | HSBC | 45.311 | 33.769 | Adaptive Biotechnologies Corp | Goldman Sachs | 8.551 |
| (1.834) | Accenture Plc 'A' | HSBC | (75.891) | 36.238 | Adaptive Biotechnologies Corp | HSBC | 12.832 |
| (683) | Accenture Plc 'A' | Morgan Stanley | (10.416) | 869 | Addus HomeCare Corp | Morgan Stanley | 22.105 |
| (25.647) | ACCO Brands Corp | Bank of America | | 7.379 | Addus HomeCare Corp | Bank of America | |
| (5.799) | ACCO Brands Corp | Merrill Lynch | 10.201 | 953 | Addus HomeCare Corp | Merrill Lynch | 1.642 |
| (63.531) | ACCO Brands Corp | HSBC | 789 | 1.279 | Addus HomeCare Corp | Barclays Bank | 568 |
| 9.586 | Accolade Inc | Morgan Stanley | 24.084 | 1.861 | Addus HomeCare Corp | Goldman Sachs | 2.449 |
| 10.000 | Accolade Inc | Goldman Sachs | 7.861 | (2.483) | Adeia Inc | HSBC | 2.922 |
| 10.000 | Accolade Inc | HSBC | 750 | (26.771) | Adeia Inc | Morgan Stanley | 7 |
| 3.991 | Accolade Inc | Merrill Lynch | 2.594 | (14.452) | Adeia Inc | Bank of America | |
| 18.083 | Accuray Inc | Barclays Bank | (3.255) | (10.197) | Adeia Inc | Merrill Lynch | (1.192) |
| 51.367 | Accuray Inc | Goldman Sachs | (514) | (20.420) | Adicet Bio Inc | Barclays Bank | (8.834) |
| 84.942 | Accuray Inc | Morgan Stanley | (15.290) | (9.094) | Adicet Bio Inc | HSBC | (32.463) |
| 59.092 | ACI Worldwide Inc | Barclays Bank | (70.319) | (1.838) | Adient Plc | Morgan Stanley | (3.365) |
| (5.031) | Aclaris Therapeutics Inc | Bank of America | | 13.480 | Adient Plc | Bank of America | |
| (6.912) | Aclaris Therapeutics Inc | Merrill Lynch | 302 | 2.905 | Adient Plc | Merrill Lynch | (21.164) |
| (5.885) | Aclaris Therapeutics Inc | Barclays Bank | (670) | 8.054 | Adient Plc | Barclays Bank | (5.781) |
| (2.260) | Aclaris Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 415 | 5.844 | Adient Plc | Goldman Sachs | (12.645) |
| (1.915) | ACM Research Inc 'A' | HSBC | 824 | 8.076 | Adient Plc | HSBC | (12.155) |
| (10.330) | ACM Research Inc 'A' | Morgan Stanley | 271 | 17.982 | ADMA Biologics Inc | Morgan Stanley | (16.071) |
| (1.841) | ACM Research Inc 'A' | Bank of America | | 2.157 | Adobe Inc | Barclays Bank | (1.618) |
| (1.027) | ACNB Corp | Merrill Lynch | (670) | 3.020 | Adobe Inc | Bank of America | |
| (18.000) | ACNB Corp | Barclays Bank | (2.066) | 285 | Adobe Inc | Merrill Lynch | 150.192 |
| (14.089) | ACNB Corp | HSBC | 55 | 855 | Adobe Inc | Barclays Bank | 130.615 |
| (1.173) | ACNB Corp | Bank of America | | 3.898 | Adobe Inc | Goldman Sachs | 16.850 |
| (16.732) | Actinium Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 17.401 | 59.189 | ADT Inc | HSBC | 60.910 |
| (1.197) | Activision Blizzard Inc | Barclays Bank | (436) | (20.792) | ADT Inc | Morgan Stanley | 168.588 |
| (1.783) | Activision Blizzard Inc | Goldman Sachs | (3.103) | 26.587 | ADT Inc | Bank of America | |
| (7.216) | Activision Blizzard Inc | HSBC | (30.660) | (3.590) | Adtalem Global Education Inc | Merrill Lynch | (15.389) |
| 1.085 | Acuity Brands Inc | Bank of America | | (8.183) | Adtalem Global Education Inc | Barclays Bank | 6.653 |
| 1.818 | Acuity Brands Inc | Merrill Lynch | (7.063) | (13.533) | Adtalem Global Education Inc | Goldman Sachs | (20.164) |
| 519 | Acuity Brands Inc | Barclays Bank | (11.853) | (7.591) | Adtalem Global Education Inc | HSBC | (3.720) |
| 857 | Acuity Brands Inc | Goldman Sachs | (3.379) | (41.132) | ADTRAN Holdings Inc | Barclays Bank | 9.269 |
| 989 | Acuity Brands Inc | HSBC | (5.030) | (15.221) | ADTRAN Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.459 |
| 1.991 | Acumen Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (6.448) | 1.840 | Aduro Biotech Holdings Europe BV | Barclays Bank | 4.672 |
| 6.724 | Acumen Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | 4.665 | Aduro Biotech Holdings Europe BV | Barclays Bank | 4.672 |
| 4.817 | Acumen Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (2.668) | 2.613 | Advance Auto Parts Inc | Morgan Stanley | 11.844 |
| (727) | Acushnet Holdings Corp | Barclays Bank | (3.026) | | | Bank of America | |
| (20.489) | Acushnet Holdings Corp | Goldman Sachs | (6.455) | | | Merrill Lynch | (117.532) |
| (1.978) | Acushnet Holdings Corp | Bank of America | (646) | | | | |
| (434) | Acushnet Holdings Corp | Merrill Lynch | (19.014) | | | | |
| (10.037) | ACV Auctions Inc 'A' | Barclays Bank | (10.014) | | | | |
| (25.313) | ACV Auctions Inc 'A' | HSBC | 13.609 | | | | |
| | | Morgan Stanley | (220) | | | | |
| | | Barclays Bank | 5.320 | | | | |
| | | Goldman Sachs | (7.088) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.414 | Advance Auto Parts Inc | Barclays Bank | (102.523) | 1.092 | Affiliated Managers Group Inc | HSBC | (2.315) |
| 1.169 | Advance Auto Parts Inc | Goldman Sachs | (46.561) | 459 | Affiliated Managers Group Inc | Morgan Stanley | (1.129) |
| (2.968) | Advanced Drainage Systems Inc | Bank of America | (15.439) | 8.639 | Affirmed NV | Barclays Bank | (1.687) |
| (6.267) | Advanced Drainage Systems Inc | Barclays Bank | (8.083) | 24.812 | Affirmed NV | Goldman Sachs | (347) |
| (7.937) | Advanced Drainage Systems Inc | Goldman Sachs | (75.212) | 9.086 | Affirmed NV | HSBC | (71) |
| (1.250) | Advanced Drainage Systems Inc | HSBC | (13.456) | 10.725 | Affirm Holdings Inc | Barclays Bank | 9.384 |
| (6.864) | Advanced Drainage Systems Inc | Morgan Stanley | (9.472) | (2.969) | Affirm Holdings Inc | Barclays Bank | (2.598) |
| (10.628) | Advanced Emissions Solutions Inc | Barclays Bank | (638) | 1.938 | Affirm Holdings Inc | Goldman Sachs | 5.048 |
| (5.462) | Advanced Emissions Solutions Inc | HSBC | 2.403 | (16.486) | Aflac Inc | Bank of America | |
| (15.235) | Advanced Emissions Solutions Inc | Morgan Stanley | (914) | (71.681) | Aflac Inc | Merrill Lynch | 24.109 |
| 6.167 | Advanced Energy Industries Inc | Bank of America | 66.110 | (29.673) | Aflac Inc | Barclays Bank | 139.061 |
| 8.820 | Advanced Energy Industries Inc | Merrill Lynch | 39.602 | (46.507) | Aflac Inc | Goldman Sachs | 41.588 |
| 4.120 | Advanced Energy Industries Inc | Barclays Bank | 47.668 | (44.392) | Aflac Inc | HSBC | 139.521 |
| 9.448 | Advanced Energy Industries Inc | HSBC | 42.422 | (2.162) | AGCO Corp | Morgan Stanley | 86.120 |
| (2.672) | Advanced Micro Devices Inc | Morgan Stanley | | 6.697 | AGCO Corp | Barclays Bank | 7.718 |
| (7.614) | Advanced Micro Devices Inc | Bank of America | (27.620) | 4.838 | AGCO Corp | Goldman Sachs | (82.775) |
| (2.056) | Advanced Micro Devices Inc | Merrill Lynch | (107.249) | 2.009 | AGCO Corp | HSBC | (76.259) |
| (4.167) | Advanced Micro Devices Inc | Barclays Bank | (53.016) | 23.042 | AGCO Corp | Morgan Stanley | (7.172) |
| (3.728) | AdvanSix Inc | HSBC | (58.943) | 39.782 | Agenus Inc | Barclays Bank | (922) |
| (6.122) | AdvanSix Inc | Morgan Stanley | 1.734 | 14.700 | Agenus Inc | Goldman Sachs | (2.785) |
| (5.176) | AdvanSix Inc | Barclays Bank | 11.050 | 12.979 | Agenus Inc | HSBC | (2.058) |
| (1.271) | AdvanSix Inc | Goldman Sachs | 2.407 | 4.576 | Agilent Technologies Inc | Morgan Stanley | (519) |
| (47.080) | Advantage Solutions Inc | HSBC | 1.646 | 13.804 | Agilent Technologies Inc | Bank of America | |
| (21.247) | Advantage Solutions Inc | Barclays Bank | (3.766) | 12.097 | Agilent Technologies Inc | Merrill Lynch | (57.566) |
| 36.621 | AECOM | Bank of America | (9.349) | 16.352 | Agilent Technologies Inc | Barclays Bank | (188.838) |
| 25.015 | AECOM | Goldman Sachs | (72.876) | 10.173 | Agilent Technologies Inc | Goldman Sachs | (152.180) |
| 7.497 | AECOM | Merrill Lynch | (48.529) | (20.339) | Agiliti Inc | HSBC | (278.638) |
| 51.033 | AECOM | Barclays Bank | (14.919) | (10.071) | Agiliti Inc | Morgan Stanley | (139.166) |
| 25.737 | AECOM | HSBC | (257.207) | (5.097) | Agiliti Inc | Barclays Bank | (2.644) |
| (2.018) | Aehr Test Systems | Merrill Lynch | (15.276) | (4.093) | Agiliti Inc | Goldman Sachs | (11.582) |
| (782) | Aerovate Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.357 | (21.901) | agilon health Inc | HSBC | (1.376) |
| (4.818) | Aerovate Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 23.199 | (33.808) | agilon health Inc | Morgan Stanley | (532) |
| (922) | Aerovate Therapeutics Inc | HSBC | 5.242 | (15.465) | agilon health Inc | Bank of America | |
| (1.917) | Aerovate Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 3.326 | 519 | Agilysys Inc | Merrill Lynch | 82.567 |
| (787) | AeroVironment Inc | Bank of America | 10.469 | (33.808) | Agilysys Inc | Barclays Bank | 33.808 |
| (4.300) | AeroVironment Inc | Merrill Lynch | 10.469 | (15.465) | Agilysys Inc | Goldman Sachs | 58.303 |
| (816) | AeroVironment Inc | Barclays Bank | 71.079 | 659 | Agilysys Inc | Bank of America | |
| (1.164) | AeroVironment Inc | HSBC | 9.943 | 2.231 | Agilysys Inc | Merrill Lynch | (2.315) |
| (3.987) | AerSale Corp | Morgan Stanley | 15.008 | 1.259 | Agios Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (2.939) |
| (1.961) | AerSale Corp | Barclays Bank | 6.171 | 5.479 | Agios Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 6.224 |
| (25.303) | AerSale Corp | Goldman Sachs | 1.353 | 3.986 | Agios Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (1.335) |
| 21.302 | AES Corp | Morgan Stanley | 38.339 | (51.714) | AGNC Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (3.123) |
| 19.425 | AES Corp | Bank of America | (15.754) | (237.348) | AGNC Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (4.225) |
| 14.758 | AES Corp | Merrill Lynch | (10.070) | (27.499) | AGNC Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| 2.062 | AES Corp | Barclays Bank | (3.358) | (21.023) | AGNC Investment Corp (REIT) | Merrill Lynch | (3.361) |
| 24.042 | AES Corp | HSBC | (2.394) | (14.031) | Agree Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (3.560) |
| (14.360) | AEye Inc | Morgan Stanley | (4.279) | (15.192) | Agree Realty Corp (REIT) | HSBC | 8.662 |
| (41.198) | AEye Inc | Barclays Bank | (144) | (10.426) | Agree Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | 5.883 |
| (89.508) | AEye Inc | HSBC | 396 | (16.443) | Agree Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | 17.890 |
| 1.427 | Affiliated Managers Group Inc | Morgan Stanley | (895) | (9.971) | Agree Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 16.681 |
| 283 | Affiliated Managers Group Inc | Barclays Bank | (3.510) | (25.321) | Air Lease Corp | HSBC | 16.056 |
| | | Goldman Sachs | (651) | (953) | Air Lease Corp | Morgan Stanley | 3.065 |
| | | | | (1.742) | Air Lease Corp | Goldman Sachs | (503) |
| | | | | 668 | Air Products and Chemicals Inc | HSBC | 342 |
| | | | | | Air Products and Chemicals Inc | Morgan Stanley | 608 |
| | | | | | Air Products and Chemicals Inc | Barclays Bank | (2.806) |
| | | | | | Air Products and Chemicals Inc | Goldman Sachs | 19.128 |
| | | | | | Air Transport Services Group Inc | Morgan Stanley | (7.833) |
| | | | | | | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 47 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.506) | Air Transport Services Group Inc | Barclays Bank | (376) | 16.173 | Alerus Financial Corp | Barclays Bank | 18.114 |
| (12.799) | Air Transport Services Group Inc | HSBC | (29.694) | 11.239 | Alerus Financial Corp | Goldman Sachs | 31.469 |
| (28.643) | Air Transport Services Group Inc | Morgan Stanley | (3.318) | 23.391 | Alerus Financial Corp | HSBC | 84.208 |
| (3.589) | Airbnb Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.481 | 432 | Alerus Financial Corp | Morgan Stanley | 484 |
| (801) | Airbnb Inc 'A' | HSBC | 16.693 | 41.727 | Alexander & Baldwin Inc | Barclays Bank | (16.453) |
| (5.663) | Airbnb Inc 'A' | Morgan Stanley | 28.994 | 39.882 | Alexander & Baldwin Inc | Goldman Sachs | (14.668) |
| (6.303) | Airgain Inc | Bank of America | | 14.112 | Alexander & Baldwin Inc | HSBC | (3.951) |
| | | Merrill Lynch | (2.143) | 2.181 | Alexander & Baldwin Inc | Morgan Stanley | (602) |
| (4.677) | Airgain Inc | Barclays Bank | (1.310) | (972) | Alexander's Inc (REIT) | Bank of America | |
| (30.288) | Airgain Inc | Goldman Sachs | (10.298) | (8.113) | Alexander's Inc (REIT) | Merrill Lynch | 6.172 |
| 11.105 | Akamai Technologies Inc | Barclays Bank | 50.306 | (5.881) | Alexander's Inc (REIT) | Barclays Bank | (11.520) |
| 266 | Akamai Technologies Inc | HSBC | 3.493 | (2.208) | Alexander's Inc (REIT) | Goldman Sachs | 37.344 |
| 15.095 | Akamai Technologies Inc | Morgan Stanley | 68.380 | (2.208) | Alexander's Inc (REIT) | HSBC | 24.288 |
| 4.700 | Akazoo SA* | Bank of America | | (1.317) | Alexander's Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.870) |
| | | Merrill Lynch | (5.452) | 4.331 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Bank of America | |
| 5.417 | Akazoo SA* | Barclays Bank | (6.284) | (3.945) | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Merrill Lynch | (32.439) |
| 11.200 | Akazoo SA* | Goldman Sachs | (12.992) | 2.634 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Bank of America | 29.548 |
| 7.099 | Akazoo SA* | Morgan Stanley | (71) | (2.770) | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Barclays Bank | (11.511) |
| (6.093) | Akero Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 19.315 | 2.439 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Barclays Bank | 12.105 |
| (937) | Akero Therapeutics Inc | HSBC | 918 | 12.720 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | Goldman Sachs | (18.268) |
| (685) | Akero Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 767 | (2.698) | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | HSBC | (114.862) |
| 8.858 | Akouos Inc* | Barclays Bank | 6.998 | (2.799) | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | HSBC | 16.366 |
| (1.872) | Akoustis Technologies Inc | Bank of America | | (5.889) | Alico Inc | Morgan Stanley | 12.232 |
| | | Merrill Lynch | (412) | (5.143) | Alico Inc | Bank of America | |
| (157.161) | Akoustis Technologies Inc | Barclays Bank | (39.290) | (2.450) | Alico Inc | Merrill Lynch | (5.536) |
| (7.105) | Akoustis Technologies Inc | HSBC | (1.705) | (7.613) | Alico Inc | Barclays Bank | 3.600 |
| (55.436) | Akoustis Technologies Inc | Morgan Stanley | (13.859) | (2.157) | Alico Inc | Goldman Sachs | (2.303) |
| (8.232) | Akoya Biosciences Inc | Bank of America | | (93.590) | Alight Inc 'A' | HSBC | (6.014) |
| | | Merrill Lynch | 576 | (94.204) | Alight Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.510 |
| (7.079) | Akoya Biosciences Inc | Goldman Sachs | 496 | (20.234) | Alight Inc 'A' | Barclays Bank | 30.885 |
| 1.437 | Alamo Group Inc | Barclays Bank | (16.727) | 217 | Align Technology Inc | Goldman Sachs | 10.363 |
| 548 | Alamo Group Inc | Goldman Sachs | (4.417) | | | HSBC | 14.366 |
| 6.186 | Alarm.com Holdings Inc | Bank of America | | (269) | Align Technology Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.282 | (92) | Align Technology Inc | Merrill Lynch | (3.980) |
| 2.669 | Alarm.com Holdings Inc | Barclays Bank | (4.697) | 661 | Align Technology Inc | Goldman Sachs | 971 |
| 13.345 | Alarm.com Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.171 | (1.145) | Align Technology Inc | HSBC | 105 |
| 9.496 | Alarm.com Holdings Inc | HSBC | 34.198 | 17.529 | Alignment Healthcare Inc | Morgan Stanley | (14.469) |
| 11.209 | Alarm.com Holdings Inc | Morgan Stanley | (19.728) | | | Morgan Stanley | 20.928 |
| 25.868 | Alaska Air Group Inc | Barclays Bank | 4.027 | | | Bank of America | |
| 33.289 | Alaska Air Group Inc | Goldman Sachs | 58.256 | 17.033 | Alignment Healthcare Inc | Merrill Lynch | (18.405) |
| (8.500) | Albany International Corp 'A' | Barclays Bank | 34.340 | 9.008 | Alignment Healthcare Inc | Barclays Bank | (14.819) |
| (2.615) | Albemarle Corp | Bank of America | | (13.093) | Alkami Technology Inc | Goldman Sachs | (9.458) |
| | | Merrill Lynch | 16.690 | (10.554) | Alkami Technology Inc | Bank of America | |
| (1.603) | Albemarle Corp | Barclays Bank | 13.388 | (7.016) | Alkami Technology Inc | Merrill Lynch | (17.283) |
| (292) | Albemarle Corp | Goldman Sachs | 1.644 | 27.351 | Alkermes Plc | Barclays Bank | (1.689) |
| (777) | Albemarle Corp | HSBC | (416) | 4.211 | Alkermes Plc | Goldman Sachs | (9.261) |
| (5.062) | Albemarle Corp | Morgan Stanley | 42.420 | 15.446 | Alkermes Plc | Barclays Bank | (32.274) |
| (7.813) | Albertsons Cos Inc 'A' | Bank of America | | 10.056 | Allakos Inc | Goldman Sachs | (8.211) |
| | | Merrill Lynch | 391 | | | HSBC | (28.730) |
| (34.859) | Albertsons Cos Inc 'A' | Barclays Bank | 1.045 | | | Bank of America | |
| (47.551) | Albertsons Cos Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.377 | | | Merrill Lynch | (1.106) |
| (7.374) | Albertsons Cos Inc 'A' | HSBC | 4.056 | | | Goldman Sachs | (1.937) |
| (5.288) | Albertsons Cos Inc 'A' | Morgan Stanley | 159 | | | HSBC | 11.872 |
| 2.834 | Alcoa Corp | Bank of America | | | | Barclays Bank | (2.246) |
| | | Merrill Lynch | (5.134) | | | HSBC | 2.111 |
| 8.252 | Alcoa Corp | Barclays Bank | (22.319) | | | Morgan Stanley | (1.202) |
| 7.043 | Alcoa Corp | Goldman Sachs | (35.285) | | | Barclays Bank | (6.562) |
| 13.789 | Alcoa Corp | HSBC | (66.737) | | | HSBC | (60) |
| 5.767 | Alcoa Corp | Morgan Stanley | (21.464) | | | Morgan Stanley | (407) |
| (12.730) | Aldeyra Therapeutics Inc | Barclays Bank | 5.092 | | | Bank of America | |
| (1.868) | Aldeyra Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.588 | | | Merrill Lynch | (3.815) |
| 16.589 | Alector Inc | Bank of America | | | | Barclays Bank | 562 |
| | | Merrill Lynch | (3.815) | | | Goldman Sachs | (8.177) |
| 18.722 | Alector Inc | Barclays Bank | 562 | | | HSBC | (4.813) |
| 35.552 | Alector Inc | Goldman Sachs | (8.177) | | | Morgan Stanley | 214 |
| 20.926 | Alector Inc | HSBC | (4.813) | | | | |
| 7.120 | Alector Inc | Morgan Stanley | 214 | | | | |
| | | | | 19.939 | Allegion Plc | Barclays Bank | (80.155) |
| | | | | 27.751 | Allegion Plc | Goldman Sachs | (101.014) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 9.042 | Allegion Plc | HSBC | (18.848) | (1.416) | Alpha Metallurgical Resources Inc | HSBC | 32.865 |
| 11.222 | Allegion Plc | Morgan Stanley | (45.112) | (17.768) | Alpha Pro Tech Ltd | Barclays Bank | 1.421 |
| 2.785 | Allegro MicroSystems Inc | Bank of America | | 893 | Alpha Teknova Inc | HSBC | 1.741 |
| | | Merrill Lynch | 5.821 | 16.957 | Alphabet Inc 'A' | Barclays Bank | (32.557) |
| 1.027 | Allegro MicroSystems Inc | Barclays Bank | 1.637 | 291 | Alphabet Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.926 |
| 1.075 | Allegro MicroSystems Inc | Goldman Sachs | 304 | 1.344 | Alphabet Inc 'A' | HSBC | 20.644 |
| (1.216) | Allegro MicroSystems Inc | Morgan Stanley | (839) | 27.220 | Alphabet Inc 'A' | Morgan Stanley | (52.262) |
| 2.190 | ALLETE Inc | Goldman Sachs | (2.738) | (8.017) | Alphatec Holdings Inc | Barclays Bank | 4.009 |
| 21.952 | ALLETE Inc | HSBC | (49.172) | (1.055) | Alphatec Holdings Inc | Goldman Sachs | (285) |
| 4.052 | ALLETE Inc | Morgan Stanley | (7.739) | (4.753) | Alpine Immune Sciences Inc | Goldman Sachs | (7.652) |
| (41.818) | Alliant Energy Corp | Barclays Bank | 61.054 | (12.147) | Alta Equipment Group Inc | Barclays Bank | 7.045 |
| (84.836) | Alliant Energy Corp | Goldman Sachs | 242.981 | (23.981) | Alta Equipment Group Inc | Goldman Sachs | 24.221 |
| (10.517) | Alliant Energy Corp | HSBC | 34.879 | (17.708) | Altair Engineering Inc 'A' | Goldman Sachs | (124.310) |
| (38.654) | Alliant Energy Corp | Morgan Stanley | 54.422 | 6.581 | Alteryx Inc 'A' | Bank of America | |
| 4.073 | Allied Motion Technologies Inc | Bank of America | | | Merrill Lynch | Merrill Lynch | 2.567 |
| | | Merrill Lynch | 5.277 | 3.450 | Alteryx Inc 'A' | Barclays Bank | (7.832) |
| 9.176 | Allied Motion Technologies Inc | Barclays Bank | 2.202 | 6.786 | Alteryx Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.647 |
| 2.595 | Allied Motion Technologies Inc | Goldman Sachs | 3.124 | 5.329 | Alteryx Inc 'A' | HSBC | 4.476 |
| 3.686 | Allied Motion Technologies Inc | HSBC | 4.957 | 884 | Alteryx Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.007) |
| 1.119 | Allied Motion Technologies Inc | Morgan Stanley | 42 | 74.333 | Altice USA Inc 'A' | Bank of America | |
| (919) | Allison Transmission Holdings Inc | Bank of America | 414 | 73.039 | Altice USA Inc 'A' | Merrill Lynch | (14.866) |
| 32.302 | Allison Transmission Holdings Inc | Merrill Lynch | | 100.653 | Altice USA Inc 'A' | Barclays Bank | (2.922) |
| | | Barclays Bank | (31.333) | 22.270 | Altice USA Inc 'A' | HSBC | (40.261) |
| (15.203) | Allison Transmission Holdings Inc | Barclays Bank | 14.747 | (8.275) | Altimmune Inc | Morgan Stanley | (891) |
| 3.909 | Allison Transmission Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.759) | (5.730) | Altimmune Inc | Bank of America | 6.206 |
| (14.084) | Allison Transmission Holdings Inc | Goldman Sachs | 7.347 | 24.189 | Alto Ingredients Inc | Goldman Sachs | 4.298 |
| 9.826 | Allison Transmission Holdings Inc | HSBC | (98) | 33.605 | Alto Ingredients Inc | Bank of America | |
| (4.235) | Allison Transmission Holdings Inc | HSBC | 2.811 | 22.241 | Alto Ingredients Inc | Merrill Lynch | (1.451) |
| (4.313) | Allison Transmission Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.184 | 25.853 | Alto Ingredients Inc | Barclays Bank | (8.401) |
| 10.182 | Allogene Therapeutics Inc | Barclays Bank | (8.960) | 22.119 | Alto Ingredients Inc | Goldman Sachs | (1.334) |
| 17.423 | Allogene Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (26.657) | (7.086) | Altria Group Inc | HSBC | 17.063 |
| 19.860 | Allovir Inc | Barclays Bank | (11.519) | (5.775) | Altria Group Inc | Morgan Stanley | (5.530) |
| 4.246 | Allovir Inc | Goldman Sachs | (2.293) | (709) | Altria Group Inc | Bank of America | 5.840 |
| 8.248 | Allstate Corp | Bank of America | | (3.524) | Altria Group Inc | Merrill Lynch | 5.840 |
| | | Merrill Lynch | (66.809) | (21.364) | Altria Group Inc | Barclays Bank | 3.638 |
| 16.043 | Allstate Corp | Barclays Bank | (132.515) | (34.057) | Altus Power Inc | Goldman Sachs | 707 |
| 14.860 | Allstate Corp | Goldman Sachs | (120.366) | 5.967 | ALX Oncology Holdings Inc | HSBC | 2.264 |
| 2.552 | Allstate Corp | HSBC | (16.052) | 12.103 | ALX Oncology Holdings Inc | Morgan Stanley | 13.441 |
| 9.862 | Allstate Corp | Morgan Stanley | (81.460) | 2.811 | ALX Oncology Holdings Inc | Bank of America | |
| (28.622) | Ally Financial Inc | Bank of America | | 9.702 | ALX Oncology Holdings Inc | Merrill Lynch | 23.159 |
| | | Merrill Lynch | (36.184) | 2.116 | ALX Oncology Holdings Inc | Barclays Bank | 566 |
| (28.877) | Ally Financial Inc | Barclays Bank | (3.176) | 7.462 | Amalgamated Financial Corp | Morgan Stanley | 5.681 |
| (1.051) | Ally Financial Inc | Goldman Sachs | (1.503) | 21.613 | Amalgamated Financial Corp | Bank of America | 1.551 |
| (6.729) | Ally Financial Inc | HSBC | (12.301) | 33.241 | Amalgamated Financial Corp | Merrill Lynch | 2.663 |
| (17.068) | Ally Financial Inc | Morgan Stanley | (5.254) | 2.746 | Amalgamated Financial Corp | Barclays Bank | (20.316) |
| (876) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 4.179 | 7.487 | Amalgamated Financial Corp | Goldman Sachs | (4.916) |
| (1.288) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | HSBC | 27.911 | (4.634) | A-Mark Precious Metals Inc | HSBC | (440) |
| (1.886) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 8.996 | (1.824) | A-Mark Precious Metals Inc | Morgan Stanley | (5.046) |
| (10.668) | Alpha & Omega Semiconductor Ltd | Barclays Bank | (2.880) | (7.384) | A-Mark Precious Metals Inc | Barclays Bank | 13.392 |
| (11.529) | Alpha & Omega Semiconductor Ltd | Goldman Sachs | (39.660) | (323) | Amazon.com Inc | Goldman Sachs | 4.213 |
| (14.816) | Alpha & Omega Semiconductor Ltd | HSBC | (58.227) | (1.111) | Amazon.com Inc | HSBC | 16.540 |
| (1.786) | Alpha Metallurgical Resources Inc | Bank of America | | 4.338 | Ambac Financial Group Inc | Goldman Sachs | (2.189) |
| | | Merrill Lynch | 34.934 | 6.696 | Ambac Financial Group Inc | HSBC | (6.148) |
| | | | | 10.148 | Ambac Financial Group Inc | Merrill Lynch | (3.557) |
| | | | | 8.572 | Ambac Financial Group Inc | Barclays Bank | (737) |
| | | | | | Ambac Financial Group Inc | Goldman Sachs | (8.321) |
| | | | | | Ambac Financial Group Inc | HSBC | (9.429) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.442 | Ambac Financial Group Inc | Morgan Stanley | (159) | (14.277) | American Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | 108.185 |
| 1.567 | Ambarella Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.651 | (31.942) | American Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | 140.865 |
| 1.812 | Ambarella Inc | Barclays Bank | (6.922) | (3.272) | American Equity Investment Life Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | (5.072) |
| 2.648 | Ambarella Inc | Goldman Sachs | 6.170 | (43.106) | American Equity Investment Life Holding Co | Barclays Bank | (28.019) |
| 2.428 | Ambarella Inc | HSBC | 8.134 | (9.974) | American Equity Investment Life Holding Co | Goldman Sachs | (15.460) |
| 2.971 | Ambarella Inc | Morgan Stanley | (11.349) | (13.861) | American Equity Investment Life Holding Co | HSBC | (4.737) |
| (3.976) | AMC Entertainment Holdings Inc | Barclays Bank | 179 | (2.413) | American Equity Investment Life Holding Co | Morgan Stanley | (1.568) |
| 2.187 | AMC Entertainment Holdings Inc | HSBC | 11 | 19.761 | American Express Co | Goldman Sachs | 166.980 |
| (5.402) | AMC Networks Inc 'A' | Barclays Bank | 8.211 | 2.528 | American Express Co | HSBC | 13.676 |
| (6.642) | AMC Networks Inc 'A' | Goldman Sachs | 17.402 | 1.423 | American Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.308) |
| (9.021) | AMC Networks Inc 'A' | HSBC | 32.295 | 12.030 | American Financial Group Inc | Barclays Bank | (34.045) |
| (1.906) | Ancor Plc | Barclays Bank | 158 | 8.014 | American Financial Group Inc | Goldman Sachs | (29.892) |
| 92.082 | Ancor Plc | Barclays Bank | (57.091) | 18.310 | American Financial Group Inc | HSBC | (36.803) |
| 2.850 | Ancor Plc | Goldman Sachs | (2.024) | 15.102 | American Financial Group Inc | Morgan Stanley | (42.739) |
| (75.145) | Ancor Plc | HSBC | 60.867 | (37.527) | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Barclays Bank | (15.761) |
| 97.010 | Ancor Plc | HSBC | (78.578) | (2.132) | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | HSBC | 1.855 |
| (54.226) | Ancor Plc | Morgan Stanley | 19.006 | (12.276) | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Morgan Stanley | (5.156) |
| (2.470) | Amdocs Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.406 | (17.604) | American International Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (26.230) |
| (8.854) | Amdocs Ltd | Barclays Bank | 1.594 | (43.708) | American International Group Inc | Barclays Bank | (3.060) |
| (21.699) | Amdocs Ltd | Goldman Sachs | (64.118) | (9.078) | American International Group Inc | HSBC | (2.542) |
| (286) | Amdocs Ltd | HSBC | (1.158) | (14.046) | American International Group Inc | Morgan Stanley | (983) |
| (1.451) | Amdocs Ltd | Morgan Stanley | 997 | (7.446) | American National Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.372) |
| 310 | Amedisys Inc | Barclays Bank | (406) | (6.617) | American National Bankshares Inc | Barclays Bank | (199) |
| 809 | Amedisys Inc | Goldman Sachs | 769 | (5.026) | American National Bankshares Inc | HSBC | (9.047) |
| 1.083 | Amedisys Inc | HSBC | (5.307) | (6.292) | American National Bankshares Inc | Morgan Stanley | (189) |
| 2.113 | Amedisys Inc | Morgan Stanley | (7.797) | (6.099) | American Outdoor Brands Inc | Barclays Bank | 2.928 |
| (19.963) | Amerant Bancorp Inc | Barclays Bank | (2.994) | 10.612 | American Public Education Inc | Barclays Bank | (12.947) |
| (20.519) | Amerant Bancorp Inc | Goldman Sachs | (29.547) | 24.238 | American Public Education Inc | HSBC | (10.907) |
| (12.921) | Amerant Bancorp Inc | HSBC | (21.320) | 4.305 | American Public Education Inc | Morgan Stanley | (5.252) |
| 2.989 | Ameren Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.215) | (8.040) | American Realty Investors Inc | Barclays Bank | (2.291) |
| 643 | Ameren Corp | Goldman Sachs | (3.119) | (1.386) | American Realty Investors Inc | Morgan Stanley | (395) |
| 1.935 | Ameren Corp | HSBC | (1.093) | (38.194) | American Software Inc 'A' | Barclays Bank | 9.167 |
| 21.301 | Ameren Corp | Morgan Stanley | (66.901) | (17.011) | American Software Inc 'A' | Goldman Sachs | (7.655) |
| (2.538) | Ameresco Inc 'A' | Barclays Bank | 4.924 | (10.870) | American States Water Co | Barclays Bank | 7.935 |
| (1.710) | Ameresco Inc 'A' | Goldman Sachs | 547 | (25.519) | American States Water Co | Goldman Sachs | 53.080 |
| (14) | Ameresco Inc 'A' | Morgan Stanley | 27 | 5.758 | American Superconductor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (173) |
| (16.241) | American Airlines Group Inc | Barclays Bank | (7.958) | 4.627 | American Superconductor Corp | HSBC | 1.851 |
| 3.030 | American Airlines Group Inc | Barclays Bank | 1.485 | 4.483 | American Superconductor Corp | Morgan Stanley | 179 |
| (10) | American Airlines Group Inc | HSBC | (8) | | | | |
| 42.372 | American Assets Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 8.474 | | | | |
| 52.971 | American Assets Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (9.535) | | | | |
| 23.218 | American Assets Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 4.644 | | | | |
| 49.145 | American Assets Trust Inc (REIT) | HSBC | 12.778 | | | | |
| 10.235 | American Assets Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.842) | | | | |
| (10.097) | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | Barclays Bank | 2.120 | | | | |
| (9.902) | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | HSBC | 3.763 | | | | |
| 48.909 | American Eagle Outfitters Inc | Barclays Bank | (59.854) | | | | |
| 13.346 | American Eagle Outfitters Inc | Goldman Sachs | (31.630) | | | | |
| 8.325 | American Eagle Outfitters Inc | HSBC | (24.226) | | | | |
| 34.764 | American Eagle Outfitters Inc | Morgan Stanley | (42.760) | | | | |
| (13.664) | American Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 99.534 | | | | |
| (35.104) | American Electric Power Co Inc | Barclays Bank | 154.809 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.249 | American Tower Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (18.710) | (11.800) | Amicus Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (472) |
| 4.711 | American Tower Corp (REIT) | Barclays Bank | (61.196) | (31.774) | Amicus Therapeutics Inc | HSBC | 27.174 |
| 659 | American Tower Corp (REIT) | HSBC | (8.389) | (7.509) | Amicus Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 4.205 |
| 3.879 | American Tower Corp (REIT) | Morgan Stanley | (50.388) | 5.462 | Amkor Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 11.527 |
| 21.479 | American Vanguard Corp | Barclays Bank | (4.940) | (3.791) | Amkor Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (13.344) |
| 11.594 | American Vanguard Corp | HSBC | (17.391) | 22.416 | Amkor Technology Inc | Barclays Bank | 48.867 |
| 11.244 | American Vanguard Corp | Morgan Stanley | (2.586) | 18.144 | Amkor Technology Inc | Goldman Sachs | 60.865 |
| (10.534) | American Water Works Co Inc | Barclays Bank | 3.930 | 14.639 | Amkor Technology Inc | HSBC | 50.305 |
| (13.381) | American Water Works Co Inc | Goldman Sachs | 58.674 | (3.270) | Amkor Technology Inc | HSBC | (13.015) |
| (4.951) | American Water Works Co Inc | HSBC | 20.053 | (6.123) | Amkor Technology Inc | Morgan Stanley | (13.348) |
| (6.960) | American Water Works Co Inc | Morgan Stanley | 3.689 | 4.961 | Amkor Technology Inc | Morgan Stanley | 9.353 |
| 18.276 | American Well Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 3.290 | (52.634) | AMMO Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.895) |
| 61.204 | American Well Corp 'A' | Barclays Bank | (1.836) | (59.140) | AMMO Inc | Barclays Bank | 2.070 |
| 32.238 | American Well Corp 'A' | Goldman Sachs | 5.803 | (30.771) | AMMO Inc | Goldman Sachs | (1.692) |
| 12.173 | American Well Corp 'A' (700) | HSBC | 2.313 | (16.911) | AMMO Inc | HSBC | 592 |
| (353) | American Woodmark Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6.496) | (165.195) | AMMO Inc | Morgan Stanley | 5.782 |
| (8.944) | American Woodmark Corp | Barclays Bank | (2.669) | (4.369) | AMN Healthcare Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.231 |
| (784) | American Woodmark Corp | Goldman Sachs | (83.000) | (2.832) | AMN Healthcare Services Inc | Barclays Bank | (1.293) |
| (411) | American Woodmark Corp | HSBC | (5.878) | (2.662) | AMN Healthcare Services Inc | HSBC | 2.822 |
| (2.973) | America's Car-Mart Inc | Morgan Stanley | (3.107) | (7.084) | AMN Healthcare Services Inc | Morgan Stanley | (6.087) |
| (1.940) | America's Car-Mart Inc | Barclays Bank | (5.292) | 34.890 | Amneal Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | — |
| (650) | America's Car-Mart Inc | Goldman Sachs | (10.845) | 36.256 | Amneal Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 9.789 |
| (3.850) | Americold Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | (2.249) | (3.257) | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9.673) |
| (5.501) | Americold Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 2.041 | (2.050) | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (943) |
| (12.151) | Americold Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3.961 | (6.039) | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (2.778) |
| (8.555) | Americold Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | 15.918 | (8.460) | Amphenol Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.876) |
| (7.660) | Ameriprise Financial Inc | Morgan Stanley | 4.534 | (66.191) | Amphenol Corp 'A' | Barclays Bank | (46.204) |
| (384) | Ameriprise Financial Inc | Barclays Bank | 20.299 | (8.582) | Amphenol Corp 'A' | Goldman Sachs | (8.541) |
| (1.893) | Ameriprise Financial Inc | Goldman Sachs | 962 | (24.648) | Amphenol Corp 'A' | HSBC | (13.320) |
| (2.495) | Ameriprise Financial Inc | HSBC | (14.368) | (45.706) | Amphenol Corp 'A' | Morgan Stanley | 9.599 |
| (2.584) | AMERISAFE Inc | Morgan Stanley | 5.513 | (44.285) | Amplify Energy Corp | Barclays Bank | 23.471 |
| (2.891) | AMERISAFE Inc | Barclays Bank | 7.287 | (20.180) | Amplify Energy Corp | Barclays Bank | (2.018) |
| (2.139) | AMERISAFE Inc | Goldman Sachs | 11.969 | (39.630) | Amplify Energy Corp | Goldman Sachs | (2.018) |
| (8.360) | AmerisourceBergen Corp | Morgan Stanley | 5.756 | (25.339) | Amplify Energy Corp | HSBC | 5.945 |
| (4.917) | AmerisourceBergen Corp | Barclays Bank | 56.600 | (12.564) | Amplitude Inc 'A' | Morgan Stanley | 13.430 |
| (4.188) | AmerisourceBergen Corp | Goldman Sachs | 38.795 | (4.736) | Amplitude Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 11.810 |
| (1.307) | AmerisourceBergen Corp | HSBC | 12.120 | (11.451) | Amplitude Inc 'A' | Barclays Bank | — |
| (9.423) | Ames National Corp | Morgan Stanley | 8.888 | (3.622) | Amylyx Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 10.764 |
| (14.000) | Ames National Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.392) | (2.654) | Amylyx Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 13.945 |
| (19.049) | Ames National Corp | Barclays Bank | (6.580) | (7.117) | Amylyx Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 10.218 |
| (635) | Ames National Corp | Goldman Sachs | (6.858) | (4.554) | Amylyx Pharmaceuticals Inc | HSBC | 39.571 |
| (4.150) | Ames National Corp | HSBC | (13) | (4.554) | Amylyx Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 12.660 |
| 25.910 | AMETEK Inc | Morgan Stanley | (1.951) | 25.368 | Amylyx Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 1.383 |
| 9.546 | AMETEK Inc | Barclays Bank | (50.783) | 15.198 | Amyris Inc | Barclays Bank | 2.040 |
| 16.318 | AMETEK Inc | Goldman Sachs | (3.532) | 13.748 | Amyris Inc | Goldman Sachs | (203) |
| 13.681 | AMETEK Inc | HSBC | 15.503 | 4.044 | Analog Devices Inc | HSBC | (53.745) |
| 3.734 | Amgen Inc | Morgan Stanley | (26.815) | 375 | Analog Devices Inc | Barclays Bank | (2.381) |
| 10.395 | Amgen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (56.010) | (11.164) | AnaptysBio Inc | Goldman Sachs | 6.698 |
| 1.910 | Amgen Inc | Goldman Sachs | (155.925) | (712) | AnaptysBio Inc | Morgan Stanley | 862 |
| (537) | Amgen Inc | Barclays Bank | (14.816) | (22.471) | Anavex Life Sciences Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6.854 |
| 2.026 | Amgen Inc | Merrill Lynch | (11.062) | (13.217) | Anavex Life Sciences Corp | Goldman Sachs | 4.031 |
| (32.122) | Amicus Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 17.989 | (31.739) | Anavex Life Sciences Corp | Morgan Stanley | 9.998 |
| | | HSBC | | (2.225) | Andersons Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.361) |
| | | Morgan Stanley | | (2.231) | Andersons Inc | Barclays Bank | 1.740 |
| | | Barclays Bank | | (2.498) | Andersons Inc | HSBC | (7.094) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (4.536) | Andersons Inc | Morgan Stanley | 3.538 | (52.557) | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | HSBC | 2.628 |
| 15.291 | AngioDynamics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 765 | 1.463 | Apellis Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.127) |
| 5.674 | AngioDynamics Inc | Barclays Bank | (1.305) | 1.970 | Apellis Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 687 |
| 13.833 | AngioDynamics Inc | Goldman Sachs | 692 | (1.004) | Apellis Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 141 |
| 14.394 | AngioDynamics Inc | HSBC | 6.477 | (1.523) | Apellis Pharmaceuticals Inc | HSBC | 6.153 |
| 21.406 | AngioDynamics Inc | Morgan Stanley | (4.923) | 346 | Apellis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 755 |
| (4.920) | ANI Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 4.330 | (1.790) | API Group Corp | Barclays Bank | 627 |
| 4.664 | Anika Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.410 | 6.311 | Apogee Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | (10.413) |
| 4.771 | Anika Therapeutics Inc | Barclays Bank | (573) | 19.295 | Apogee Enterprises Inc | Barclays Bank | (34.152) |
| 4.215 | Anika Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 4.889 | 10.077 | Apogee Enterprises Inc | Goldman Sachs | (16.627) |
| 3.001 | Anika Therapeutics Inc | HSBC | 2.641 | 4.156 | Apogee Enterprises Inc | HSBC | (9.517) |
| 7.197 | Anika Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (864) | 14.067 | Apogee Enterprises Inc | Morgan Stanley | (24.899) |
| (81.209) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 798 | (2.602) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.223) |
| (46.354) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Barclays Bank | 11.536 | (84.768) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Goldman Sachs | (39.841) |
| (16.108) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.303 | (48.105) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | HSBC | (29.825) |
| (13.504) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | HSBC | (1.346) | (11.767) | Apollo Global Management Inc | Bank of America Merrill Lynch | (47.657) |
| (63.791) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Morgan Stanley | 18.499 | (5.009) | Apollo Global Management Inc | Barclays Bank | (6.161) |
| 15.434 | Annexon Inc | Barclays Bank | (49.080) | (21.503) | Apollo Global Management Inc | Goldman Sachs | (86.509) |
| 17.446 | Annexon Inc | Goldman Sachs | (57.223) | (6.269) | Apollo Global Management Inc | HSBC | (33.853) |
| 13.109 | Annexon Inc | HSBC | (32.379) | (15.031) | Apollo Global Management Inc | Morgan Stanley | (18.488) |
| 389 | ANSYS Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.597 | (2.249) | Apollo Medical Holdings Inc | Barclays Bank | 1.777 |
| 914 | ANSYS Inc | Barclays Bank | 22.361 | (8.063) | Apollo Medical Holdings Inc | Goldman Sachs | 25.157 |
| 501 | ANSYS Inc | Goldman Sachs | 13.913 | (547) | Apollo Medical Holdings Inc | HSBC | 1.172 |
| 796 | ANSYS Inc | Morgan Stanley | 22.229 | (1.621) | Apollo Medical Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.281 |
| (1.640) | Anterix Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.264) | 5.204 | Appfolio Inc 'A' | Goldman Sachs | (7.858) |
| (8.493) | Anterix Inc | Barclays Bank | 170 | 1.332 | Appfolio Inc 'A' | HSBC | 3.104 |
| (6.736) | Anterix Inc | Goldman Sachs | (13.405) | (3.975) | Appian Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (24.884) |
| (15.699) | Anterix Inc | HSBC | (18.054) | (1.292) | Appian Corp 'A' | Barclays Bank | (1.537) |
| 11.335 | Antero Midstream Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.081) | (3.471) | Appian Corp 'A' | Goldman Sachs | (21.728) |
| (157.093) | Antero Midstream Corp | Barclays Bank | 102.110 | (11.278) | Appian Corp 'A' | HSBC | (76.916) |
| 18.455 | Antero Midstream Corp | Barclays Bank | (11.996) | (5.822) | Appian Corp 'A' | Morgan Stanley | (7.762) |
| (96.261) | Antero Midstream Corp | Goldman Sachs | 34.654 | 16.657 | Apple Hospitality Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (4.966) |
| 3.389 | Antero Midstream Corp | Goldman Sachs | (1.220) | 83.194 | Apple Hospitality Inc (REIT) | Barclays Bank | (44.381) |
| (161.457) | Antero Midstream Corp | HSBC | 29.062 | 81.851 | Apple Hospitality Inc (REIT) | Goldman Sachs | (61.134) |
| 9.610 | Antero Midstream Corp | HSBC | (1.730) | 23.295 | Apple Hospitality Inc (REIT) | HSBC | (14.892) |
| (17.666) | Antero Midstream Corp | Morgan Stanley | 11.483 | 71.968 | Apple Hospitality Inc (REIT) | Morgan Stanley | (37.893) |
| 12.537 | Antero Midstream Corp | Morgan Stanley | (8.149) | 5.361 | Apple Inc | Bank of America Merrill Lynch | 35.346 |
| (15.459) | Antero Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | 30.145 | 535 | Apple Inc | Barclays Bank | 2.523 |
| (12.625) | Antero Resources Corp | Barclays Bank | 40.779 | 765 | Apple Inc | Goldman Sachs | 5.236 |
| (7.867) | Antero Resources Corp | Goldman Sachs | 15.341 | 6.846 | Apple Inc | HSBC | 38.967 |
| (11.665) | Antero Resources Corp | HSBC | 3.966 | 10.239 | Apple Inc | Morgan Stanley | 48.277 |
| (3.524) | Antero Resources Corp | Morgan Stanley | 11.383 | (40.645) | Applied Digital Corp | Barclays Bank | (1.626) |
| (29.632) | Anywhere Real Estate Inc | Barclays Bank | 15.705 | 880 | Applied Industrial Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.650) |
| (3.169) | Anywhere Real Estate Inc | HSBC | (1.711) | 2.574 | Applied Industrial Technologies Inc | Barclays Bank | (8.058) |
| (10.284) | Anywhere Real Estate Inc | Morgan Stanley | 5.451 | 13.208 | Applied Industrial Technologies Inc | Goldman Sachs | (47.240) |
| 1.243 | Aon Plc 'A' | Barclays Bank | (22.486) | 2.809 | Applied Industrial Technologies Inc | HSBC | (7.615) |
| 1.387 | Aon Plc 'A' | Morgan Stanley | (25.091) | 1.009 | Applied Industrial Technologies Inc | Morgan Stanley | (2.321) |
| (2.755) | APA Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.179 | 5.679 | Applied Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | 76.780 |
| 18.021 | APA Corp | Barclays Bank | (43.431) | 8.568 | Applied Materials Inc | Barclays Bank | 69.229 |
| (7.032) | APA Corp | Barclays Bank | 14.031 | 12.956 | Applied Materials Inc | Goldman Sachs | 175.165 |
| 17.355 | APA Corp | HSBC | (35.057) | | | | |
| (2.462) | APA Corp | Morgan Stanley | 5.933 | | | | |
| (65.116) | Apartment Income Corp (REIT) | Barclays Bank | 42.976 | | | | |
| (44.798) | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Barclays Bank | 16.575 | | | | |
| (51.048) | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 15.314 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 28.736 | Applied Materials Inc | HSBC | 533.148 | 37.897 | Archrock Inc | Goldman Sachs | (19.706) |
| 9.860 | Applied Materials Inc | Morgan Stanley | 79.668 | 25.071 | Archrock Inc | HSBC | (18.051) |
| 22.598 | Applied Molecular Transport Inc | Bank of America | | 10.693 | Archrock Inc | Morgan Stanley | (4.188) |
| | | Merrill Lynch | (34) | (1.391) | Arcosa Inc | Bank of America | |
| 10.154 | Applied Molecular Transport Inc | | | (2.798) | Arcosa Inc | Merrill Lynch | 3.408 |
| | | Barclays Bank | 144 | (534) | Arcosa Inc | Barclays Bank | 7.191 |
| 6.801 | Applied Molecular Transport Inc | | | (1.563) | Arcosa Inc | HSBC | 870 |
| | | Goldman Sachs | (10) | 361 | Arcosa Inc | Morgan Stanley | 4.017 |
| 7.008 | Applied Molecular Transport Inc | | | | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | | |
| | | Morgan Stanley | 100 | | | HSBC | (596) |
| 38.650 | Applied Optoelectronics Inc | Barclays Bank | 20.484 | 1.816 | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | | |
| 24.430 | Applied Optoelectronics Inc | Goldman Sachs | 15.879 | | | Morgan Stanley | (581) |
| 18.087 | Applied Optoelectronics Inc | HSBC | 9.405 | 6.261 | Arcus Biosciences Inc | Barclays Bank | 9.955 |
| 7.943 | Applied Optoelectronics Inc | Morgan Stanley | 4.210 | (8.179) | Arcutis Biotherapeutics Inc | Bank of America | |
| (7.795) | AppLovin Corp 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 18.573 |
| | | Merrill Lynch | (14.343) | (7.419) | Arcutis Biotherapeutics Inc | Barclays Bank | 15.802 |
| (11.304) | AppLovin Corp 'A' | Barclays Bank | 7.009 | (8.522) | Arcutis Biotherapeutics Inc | Goldman Sachs | 22.072 |
| (2.491) | AppLovin Corp 'A' | HSBC | (17.063) | (3.643) | Arcutis Biotherapeutics Inc | Morgan Stanley | 7.760 |
| (18.550) | AppLovin Corp 'A' | Morgan Stanley | 11.501 | (5.094) | Ardagh Group SA* | Barclays Bank | 98.671 |
| 1.016 | AptarGroup Inc | Bank of America | | (10.777) | Ardagh Group SA* | Goldman Sachs | 208.750 |
| | | Merrill Lynch | (3.199) | (13.020) | Ardagh Group SA* | HSBC | 252.197 |
| 7.692 | AptarGroup Inc | Barclays Bank | (28.622) | 50.213 | Ardagh Metal Packaging SA | Bank of America | |
| 1.479 | AptarGroup Inc | Goldman Sachs | (5.957) | | | Merrill Lynch | (1.506) |
| 4.821 | AptarGroup Inc | HSBC | (10.336) | 23.505 | Ardagh Metal Packaging SA | Barclays Bank | (940) |
| 3.273 | AptarGroup Inc | Morgan Stanley | (13.643) | 63.915 | Ardagh Metal Packaging SA | Goldman Sachs | (1.918) |
| 6.349 | Aptiv Plc | Barclays Bank | (39.618) | 140.660 | Ardagh Metal Packaging SA | HSBC | (37.979) |
| 1.847 | Aptiv Plc | Goldman Sachs | (5.925) | 52.765 | Ardagh Metal Packaging SA | Morgan Stanley | (2.111) |
| 1.053 | Aptiv Plc | Morgan Stanley | (3.202) | (74.577) | Ardelyx Inc | Goldman Sachs | 92.475 |
| (6.122) | Apyx Medical Corp | Barclays Bank | (735) | 47.423 | Ardmore Shipping Corp | Goldman Sachs | (36.041) |
| (8.089) | Apyx Medical Corp | Goldman Sachs | (4.368) | 2.240 | Ardmore Shipping Corp | HSBC | (3.606) |
| (6.394) | Aqua Metals Inc | Bank of America | | (24.586) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | | |
| | | Merrill Lynch | 128 | | | Barclays Bank | (4.917) |
| (63.743) | Aqua Metals Inc | Morgan Stanley | 5.099 | (58.645) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | | |
| (33.839) | Aramark | Bank of America | | | | Goldman Sachs | (45.157) |
| | | Merrill Lynch | (44.963) | 360 | Ares Management Corp 'A' | Bank of America | |
| (44.101) | Aramark | Barclays Bank | 10.507 | | | Merrill Lynch | (432) |
| (7.194) | Aramark | Goldman Sachs | (8.422) | (6.100) | Argan Inc | Bank of America | |
| (23.745) | Aramark | HSBC | (64.574) | | | Merrill Lynch | 5.917 |
| (33.385) | Aramark | Morgan Stanley | 10.344 | (7.444) | Argan Inc | Barclays Bank | (223) |
| 85.854 | Arbor Realty Trust Inc (REIT) | | | (7.860) | Argan Inc | Goldman Sachs | 7.624 |
| | | Goldman Sachs | 10.723 | (7.864) | Argan Inc | HSBC | (9.437) |
| (32.944) | Arbutus Biopharma Corp | Bank of America | | (3.369) | Argan Inc | Morgan Stanley | (101) |
| | | Merrill Lynch | 2.289 | 771 | Argo Group International Holdings Ltd | Bank of America | |
| (24.754) | Arbutus Biopharma Corp | Barclays Bank | 3.094 | | | Merrill Lynch | (31) |
| (22.925) | Arbutus Biopharma Corp | HSBC | 2.636 | 746 | Argo Group International Holdings Ltd | | |
| (18.902) | Arbutus Biopharma Corp | Morgan Stanley | 2.363 | 1.795 | Argo Group International Holdings Ltd | Barclays Bank | — |
| 38.754 | ARC Document Solutions Inc | Bank of America | | | | Goldman Sachs | (72) |
| | | Merrill Lynch | (4.263) | 1.788 | Argo Group International Holdings Ltd | HSBC | (268) |
| (351) | ArcBest Corp | Barclays Bank | 551 | 689 | Argo Group International Holdings Ltd | | |
| (7.266) | ArcBest Corp | HSBC | 16.348 | | | Morgan Stanley | — |
| (1.333) | ArcBest Corp | Morgan Stanley | 2.144 | 4.112 | Arhaus Inc | HSBC | (5.099) |
| (30) | Arcellx Inc | Bank of America | | 9.766 | Arhaus Inc | Morgan Stanley | (2.783) |
| | | Merrill Lynch | (30) | (29.360) | Aris Water Solutions Inc 'A' | Bank of America | |
| (7.779) | Arcellx Inc | Goldman Sachs | (7.779) | | | Merrill Lynch | 4.991 |
| (658) | Arcellx Inc | HSBC | (803) | (9.061) | Aris Water Solutions Inc 'A' | Barclays Bank | 4.802 |
| 6.925 | Arch Capital Group Ltd | Bank of America | | (21.239) | Aris Water Solutions Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.611 |
| | | Merrill Lynch | (1.872) | (12.064) | Aris Water Solutions Inc 'A' | HSBC | (22.560) |
| 6.820 | Arch Capital Group Ltd | Barclays Bank | (7.377) | (13.513) | Aris Water Solutions Inc 'A' | Morgan Stanley | 7.162 |
| 1.893 | Arch Capital Group Ltd | Goldman Sachs | (4.027) | 527 | Arista Networks Inc | Barclays Bank | 13.070 |
| 6.237 | Arch Capital Group Ltd | Morgan Stanley | (9.942) | (1.840) | Arista Networks Inc | HSBC | (12.954) |
| (27.945) | Archer Aviation Inc 'A' | Goldman Sachs | (19.003) | 1.919 | Arista Networks Inc | Morgan Stanley | 51.364 |
| (34.532) | Archer Aviation Inc 'A' | HSBC | (31.424) | 36.180 | Arko Corp | Bank of America | |
| 6.557 | Archer-Daniels-Midland Co | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 13.387 |
| | | Merrill Lynch | (35.015) | 21.073 | Arko Corp | Barclays Bank | (4.636) |
| 28.785 | Archer-Daniels-Midland Co | Barclays Bank | (78.295) | 33.073 | Arko Corp | Goldman Sachs | 12.237 |
| 1.453 | Archer-Daniels-Midland Co | HSBC | (4.364) | 31.350 | Arko Corp | HSBC | (17.289) |
| 18.244 | Archer-Daniels-Midland Co | Morgan Stanley | (48.436) | 23.308 | Arko Corp | Morgan Stanley | (5.128) |
| 20.574 | Archrock Inc | Bank of America | | 13.020 | Arlo Technologies Inc | Barclays Bank | 3.385 |
| | | Merrill Lynch | (10.548) | | | | |
| 11.351 | Archrock Inc | Barclays Bank | (4.553) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 8.368 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.427) | 2.758 | Arvinas Inc | HSBC | (8.164) |
| 89.472 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (40.262) | 5.471 | Arvinas Inc | Morgan Stanley | (13.295) |
| 42.742 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (12.395) | (1.905) | Asana Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (8.695) |
| 22.658 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | HSBC | (25.830) | (5.208) | Asana Inc 'A' | HSBC | (26.568) |
| 8.203 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (3.691) | 11.016 | Asana Inc 'A' | HSBC | 67.969 |
| (92.256) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (13.838) | (11.391) | Asana Inc 'A' | Morgan Stanley | (25.858) |
| (42.236) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Barclays Bank | (8.870) | (1.256) | Asbury Automotive Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (13.653) |
| (27.224) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | (4.084) | (145) | Asbury Automotive Group Inc | Barclays Bank | (1.244) |
| (153.485) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Morgan Stanley | (32.232) | (3.123) | Asbury Automotive Group Inc | Goldman Sachs | (33.947) |
| (4.324) | Armstrong World Industries Inc | Barclays Bank | 10.248 | (1.679) | Asbury Automotive Group Inc | HSBC | (18.553) |
| (3.500) | Armstrong World Industries Inc | Goldman Sachs | 8.820 | 350 | Asbury Automotive Group Inc | HSBC | 3.868 |
| (1.652) | Armstrong World Industries Inc | HSBC | 5.980 | (628) | Asbury Automotive Group Inc | Morgan Stanley | (5.389) |
| (16.899) | Array Technologies Inc | Barclays Bank | 29.573 | 604 | Asbury Automotive Group Inc | Morgan Stanley | 5.182 |
| (2.817) | Array Technologies Inc | Goldman Sachs | 2.338 | (11.680) | Ascent Global Logistics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 117 |
| (3.047) | Array Technologies Inc | HSBC | (12.066) | (16.747) | Ascent Global Logistics Inc | Goldman Sachs | 17 |
| (3.028) | Arrow Electronics Inc | Barclays Bank | (7.176) | (3.298) | Ascent Global Logistics Inc | HSBC | — |
| 4.143 | Arrow Electronics Inc | Goldman Sachs | 26.598 | (9.988) | Ascent Global Logistics Inc [†] | Morgan Stanley | — |
| 3.370 | Arrow Electronics Inc | Morgan Stanley | 7.987 | (95.171) | Asensus Surgical Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.791 |
| (2.861) | Arrow Electronics Inc | Morgan Stanley | (6.781) | (52.019) | Asensus Surgical Inc | Barclays Bank | 4.557 |
| (20.645) | Arrow Financial Corp | Barclays Bank | 16.310 | 1.055 | ASGN Inc | Bank of America Merrill Lynch | 929 |
| (25.241) | Arrow Financial Corp | Goldman Sachs | (1.514) | 7.922 | ASGN Inc | Barclays Bank | (15.607) |
| (14.429) | Arrow Financial Corp | HSBC | 13.563 | 8.743 | ASGN Inc | Morgan Stanley | (17.224) |
| (8.266) | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 25.129 | (21.971) | Ashford Hospitality Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (6.811) |
| 8.810 | ARS Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (16.651) | (60.961) | Ashford Hospitality Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 11.583 |
| (935) | Arteris Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.786) | (16.416) | Ashford Hospitality Trust Inc (REIT) | HSBC | 3.119 |
| (24.886) | Arteris Inc | Barclays Bank | (47.532) | (10.482) | Ashford Hospitality Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.992 |
| (4.322) | Arteris Inc | Goldman Sachs | (12.880) | 4.838 | Ashland Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16.657) |
| (3.042) | Artesian Resources Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 18.647 | 1.275 | Ashland Inc | Barclays Bank | (2.156) |
| (2.394) | Artesian Resources Corp 'A' | Barclays Bank | 2.179 | 576 | Ashland Inc | Goldman Sachs | (1.128) |
| (3.408) | Artesian Resources Corp 'A' | Goldman Sachs | 20.891 | 690 | Ashland Inc | HSBC | (4.000) |
| (2.192) | Artesian Resources Corp 'A' | HSBC | 13.192 | (16.308) | Aspen Aerogels Inc | Barclays Bank | 11.579 |
| (5.282) | Artesian Resources Corp 'A' | Morgan Stanley | 4.807 | (10.854) | Aspen Aerogels Inc | Goldman Sachs | 13.567 |
| (5.280) | Arthur J Gallagher & Co | Bank of America Merrill Lynch | 92.717 | (11.345) | Aspen Aerogels Inc | HSBC | 14.408 |
| (1.862) | Arthur J Gallagher & Co | Barclays Bank | 26.664 | (1.061) | Aspen Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.618 |
| (875) | Arthur J Gallagher & Co | Goldman Sachs | 15.365 | (3.173) | Aspen Technology Inc | Barclays Bank | 24.210 |
| (1.948) | Arthur J Gallagher & Co | HSBC | 29.317 | (3.171) | Aspen Technology Inc | Goldman Sachs | 10.813 |
| (7.194) | Arthur J Gallagher & Co | Morgan Stanley | 103.018 | (4.935) | Aspen Technology Inc | HSBC | 40.713 |
| 38.105 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Barclays Bank | (33.913) | (7.945) | Aspen Technology Inc | Morgan Stanley | 60.620 |
| 3.438 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Goldman Sachs | (756) | 35.928 | Assembly Biosciences Inc | Barclays Bank | (4.958) |
| 1.682 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | HSBC | (185) | 8.786 | Assembly Biosciences Inc | Goldman Sachs | (773) |
| 7.708 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.860) | 11.413 | Assembly Biosciences Inc | HSBC | (1.004) |
| 1.570 | Artivion Inc | Bank of America Merrill Lynch | 139 | 12.455 | Assembly Biosciences Inc | Morgan Stanley | (1.719) |
| 14.531 | Artivion Inc | Goldman Sachs | (5.376) | 6.394 | Assertio Holdings Inc | Barclays Bank | (3.581) |
| 5.988 | Artivion Inc | HSBC | (339) | 4.913 | Assertio Holdings Inc | HSBC | 64 |
| 9.168 | Artivion Inc | Morgan Stanley | (1.649) | 5.904 | Assertio Holdings Inc | Morgan Stanley | (159) |
| 5.750 | Arvinas Inc | Bank of America Merrill Lynch | (12.017) | 9.522 | AssetMark Financial Holdings Inc | Barclays Bank | (1.714) |
| 7.078 | Arvinas Inc | Barclays Bank | (17.199) | 1.055 | AssetMark Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 118 |
| 3.403 | Arvinas Inc | Goldman Sachs | (7.112) | 715 | AssetMark Financial Holdings Inc | HSBC | (12) |
| | | | | (29.493) | Associated Banc-Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.654) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (62.936) | Associated Banc-Corp | Barclays Bank | 39.020 | 11 | Atlas Financial Holdings Inc ¹¹ | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (3.792) | Associated Banc-Corp | Goldman Sachs | (341) | 1.171 | Atlas Lithium Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.939 |
| (27.097) | Associated Banc-Corp | HSBC | 4.065 | 1.007 | Atlas Lithium Corp | Goldman Sachs | 2.528 |
| (10.511) | Associated Banc-Corp | Morgan Stanley | 6.517 | 2.965 | Atlas Lithium Corp | HSBC | (8.692) |
| (2.895) | Associated Capital Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (4.400) | 2.771 | Atlas Lithium Corp | Morgan Stanley | 416 |
| (180) | Associated Capital Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (274) | (487) | Atlassian Corp Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (6.487) |
| (2.821) | Associated Capital Group Inc 'A' | HSBC | (5.557) | (5.807) | Atlassian Corp Ltd 'A' | Barclays Bank | (82.395) |
| (204) | Associated Capital Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 153 | (563) | Atlassian Corp Ltd 'A' | Goldman Sachs | (7.798) |
| (689) | Assurant Inc | Barclays Bank | 5.326 | (423) | Atlassian Corp Ltd 'A' | HSBC | (7.860) |
| (1.471) | Assurant Inc | Goldman Sachs | 13.563 | (291) | Atlassian Corp Ltd 'A' | Morgan Stanley | (4.176) |
| (3.437) | Assurant Inc | HSBC | 35.092 | (11.113) | Atmos Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 21.727 |
| (7.769) | Assurant Inc | Morgan Stanley | 60.054 | (19.856) | Atmos Energy Corp | Barclays Bank | 15.091 |
| 27.795 | Assured Guaranty Ltd | HSBC | (16.955) | (27.420) | Atmos Energy Corp | Goldman Sachs | 54.292 |
| 1.809 | Assured Guaranty Ltd | Morgan Stanley | (163) | (22.749) | Atmos Energy Corp | HSBC | 51.185 |
| 11.231 | Astec Industries Inc | Barclays Bank | (16.060) | (18.079) | Atmos Energy Corp | Morgan Stanley | 13.740 |
| 16.264 | Astec Industries Inc | Goldman Sachs | (17.240) | 717 | ATN International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 853 |
| 6.791 | Astec Industries Inc | HSBC | (25.874) | 11.604 | ATN International Inc | Barclays Bank | (580) |
| 2.205 | Astec Industries Inc | Morgan Stanley | (3.153) | 596 | ATN International Inc | Goldman Sachs | 709 |
| 1.692 | Astria Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.733) | 394 | ATN International Inc | HSBC | 626 |
| 3.904 | Astria Therapeutics Inc | Barclays Bank | (7.027) | (2.669) | Atomera Inc | Barclays Bank | 534 |
| 2.212 | Astria Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (3.572) | (3.140) | Atomera Inc | Goldman Sachs | (4.082) |
| 5.092 | Astronics Corp | Barclays Bank | (6.009) | (7.257) | Atomera Inc | HSBC | (1.451) |
| 229 | Astronics Corp | Goldman Sachs | (30) | (2.194) | Atomera Inc | Morgan Stanley | 439 |
| 5.661 | Asure Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.661) | 47.487 | Atreca Inc 'A' | Barclays Bank | (4.274) |
| 4.217 | Asure Software Inc | Goldman Sachs | (1.733) | 39.656 | Atreca Inc 'A' | Goldman Sachs | — |
| 3.913 | Asure Software Inc | HSBC | (5.365) | 2.386 | AtriCure Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.468) |
| 2.646 | Asure Software Inc | Morgan Stanley | (732) | 3.746 | AtriCure Inc | Barclays Bank | (16.857) |
| (25.390) | AT&T Inc | HSBC | 35.546 | 3.719 | AtriCure Inc | Goldman Sachs | (11.640) |
| (26.620) | AT&T Inc | Morgan Stanley | 17.569 | 8.349 | AtriCure Inc | HSBC | (24.546) |
| 11.015 | Atara Biotherapeutics Inc | Barclays Bank | (5.618) | 2.589 | AtriCure Inc | Morgan Stanley | (11.651) |
| 3.820 | Atara Biotherapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.330) | 600 | Atrion Corp | Morgan Stanley | (37.488) |
| (11.667) | Atea Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.884) | (7.892) | AudioEye Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.578 |
| (13.369) | Atea Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (7.888) | (1.766) | Aura Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | (989) |
| (13.463) | Athira Pharma Inc | Goldman Sachs | 2.491 | (32.921) | Aurinia Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 67.817 |
| (1.211) | ATI Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.495 | (14.255) | authID Inc | Barclays Bank | (3.843) |
| 2.372 | ATI Inc | Barclays Bank | (7.353) | 1.447 | Autodesk Inc | Bank of America Merrill Lynch | 752 |
| (3.477) | ATI Inc | Barclays Bank | 10.779 | 12.465 | Autodesk Inc | Barclays Bank | (75.538) |
| 8.628 | ATI Inc | Goldman Sachs | (17.774) | 2.397 | Autodesk Inc | HSBC | 13.040 |
| 8.228 | ATI Inc | HSBC | (28.057) | 3.669 | Autodesk Inc | Morgan Stanley | (22.234) |
| (7.605) | ATI Inc | HSBC | 25.933 | (4.805) | Autoliv Inc | Barclays Bank | 30.992 |
| 4.805 | ATI Inc | Morgan Stanley | (14.896) | (1.704) | Autoliv Inc | HSBC | 12.712 |
| (3.061) | ATI Inc | Morgan Stanley | 9.489 | (3.055) | Autoliv Inc | Morgan Stanley | 19.705 |
| 5.034 | Atkore Inc | Bank of America Merrill Lynch | (15.095) | (118) | Automatic Data Processing Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.093 |
| 12.436 | Atkore Inc | Barclays Bank | (62.012) | (104) | Automatic Data Processing Inc | Barclays Bank | 964 |
| 5.532 | Atkore Inc | Goldman Sachs | (14.310) | 417 | AutoNation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (359) |
| 5.995 | Atkore Inc | HSBC | (39.043) | 3.855 | AutoNation Inc | Barclays Bank | 1.056 |
| 4.590 | Atkore Inc | Morgan Stanley | (19.327) | 2.551 | AutoNation Inc | Goldman Sachs | 3.920 |
| (19.249) | Atlantic Union Bankshares Corp | Bank of America Merrill Lynch | (26.179) | 1.324 | AutoNation Inc | HSBC | (1.700) |
| (34.170) | Atlantic Union Bankshares Corp | Barclays Bank | (2.734) | 1.671 | AutoNation Inc | Morgan Stanley | (9.364) |
| (20.116) | Atlantic Union Bankshares Corp | HSBC | (24.743) | (34) | AutoZone Inc | Morgan Stanley | 9.581 |
| (4.846) | Atlanticus Holdings Corp | Barclays Bank | (824) | (4.127) | Avalo Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.403) |
| (3.974) | Atlanticus Holdings Corp | Goldman Sachs | (18.718) | (4.532) | Avalo Therapeutics Inc | Barclays Bank | (408) |
| (3.326) | Atlanticus Holdings Corp | HSBC | (20.023) | (909) | Avalo Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (309) |
| (592) | Atlanticus Holdings Corp | Morgan Stanley | (101) | (933) | Avalo Therapeutics Inc | HSBC | (420) |
| 1.384 | Atlas Energy Solutions Inc 'A' | HSBC | (1.882) | (4.895) | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 21.097 |
| 2.773 | Atlas Energy Solutions Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.546) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (28.806) | AvalonBay Communities Inc (REIT) | Barclays Bank | 68.270 | 21.917 | Avrobio Inc | Barclays Bank | (4.822) |
| (10.548) | AvalonBay Communities Inc (REIT) | HSBC | 63.393 | 1.185 | Avrobio Inc | Goldman Sachs | 557 |
| 10.464 | Avangrid Inc | Bank of America Merrill Lynch | (30.869) | 16.538 | Avrobio Inc | HSBC | 6.284 |
| 29.554 | Avangrid Inc | Barclays Bank | (51.720) | 19.239 | Avrobio Inc | Morgan Stanley | (4.233) |
| (18.941) | Avangrid Inc | Goldman Sachs | 55.876 | (12.652) | Axalta Coating Systems Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 17.586 |
| 5.396 | Avangrid Inc | Goldman Sachs | (15.918) | (17.203) | Axalta Coating Systems Ltd | Barclays Bank | 22.880 |
| 13.396 | Avangrid Inc | HSBC | (50.369) | (24.667) | Axalta Coating Systems Ltd | Goldman Sachs | 34.287 |
| 29.439 | Avangrid Inc | Morgan Stanley | (51.518) | (6.190) | Axalta Coating Systems Ltd | HSBC | 8.418 |
| (14.217) | Avanos Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11.438) | (6.364) | Axalta Coating Systems Ltd | Morgan Stanley | 8.464 |
| (17.653) | Avanos Medical Inc | Barclays Bank | (7.414) | 3.164 | Axcelis Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 99.191 |
| (16.353) | Avanos Medical Inc | Goldman Sachs | (12.755) | 9.961 | Axcelis Technologies Inc | Barclays Bank | 153.002 |
| (4.871) | Avanos Medical Inc | HSBC | (2.533) | 6.337 | Axcelis Technologies Inc | Goldman Sachs | 198.665 |
| (3.779) | Avanos Medical Inc | Morgan Stanley | (1.587) | 4.942 | Axcelis Technologies Inc | HSBC | 194.221 |
| (1.153) | Avantax Inc | Bank of America Merrill Lynch | 246 | 2.715 | Axcelis Technologies Inc | Morgan Stanley | 41.702 |
| (2.273) | Avantax Inc | Goldman Sachs | (659) | (16.472) | Axcella Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | 244 |
| (55.112) | Avantor Inc | Bank of America Merrill Lynch | 22.700 | (4.302) | Axcella Health Inc | Goldman Sachs | 64 |
| (54.280) | Avantor Inc | Barclays Bank | 35.728 | (168) | Axis Capital Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 506 |
| (31.086) | Avantor Inc | Goldman Sachs | 6.962 | (13.227) | Axis Capital Holdings Ltd | Barclays Bank | 52.756 |
| (16.122) | Avantor Inc | HSBC | 5.201 | (7.529) | Axis Capital Holdings Ltd | HSBC | 22.533 |
| (57.461) | Avantor Inc | Morgan Stanley | 34.884 | 9.463 | Axogen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.069) |
| 50.028 | Aveanna Healthcare Holdings Inc | Barclays Bank | (2.752) | 8.880 | Axogen Inc | Barclays Bank | (3.641) |
| 32.200 | Aveanna Healthcare Holdings Inc | Goldman Sachs | 4.347 | 12.267 | Axogen Inc | Goldman Sachs | (5.275) |
| 26.978 | Aveanna Healthcare Holdings Inc | HSBC | 4.991 | 15.140 | Axogen Inc | HSBC | (13.020) |
| 5.787 | Aveanna Healthcare Holdings Inc | Morgan Stanley | (318) | 3.015 | Axogen Inc | Morgan Stanley | (1.236) |
| (136.861) | AvePoint Inc | Barclays Bank | (51.323) | 330 | Axon Enterprise Inc | Bank of America Merrill Lynch | (291) |
| (55.900) | AvePoint Inc | HSBC | (113.757) | 5.201 | Axon Enterprise Inc | Barclays Bank | (48.831) |
| (44.638) | AvePoint Inc | Morgan Stanley | (16.739) | 114 | Axon Enterprise Inc | Goldman Sachs | (1.316) |
| (3.282) | Avery Dennison Corp | Bank of America Merrill Lynch | 39.975 | 4.225 | Axon Enterprise Inc | HSBC | (126.454) |
| (4.993) | Avery Dennison Corp | Barclays Bank | 48.232 | 6.421 | Axon Enterprise Inc | Morgan Stanley | (63.054) |
| (1.109) | Avery Dennison Corp | HSBC | 11.900 | (3.761) | Axonics Inc | Barclays Bank | 13.652 |
| (8.007) | Avery Dennison Corp | Morgan Stanley | 77.348 | (2.449) | Axonics Inc | HSBC | 17.290 |
| (8.674) | Aviat Networks Inc | Barclays Bank | 3.383 | (621) | Axonics Inc | Morgan Stanley | 2.254 |
| (3.599) | Aviat Networks Inc | HSBC | (12.345) | (2.114) | Axos Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.412) |
| (19.104) | Avid Bioservices Inc | Barclays Bank | 3.248 | (10.316) | Axos Financial Inc | Barclays Bank | 10.625 |
| (5.467) | Avid Bioservices Inc | Goldman Sachs | 13.941 | (5.179) | Axos Financial Inc | HSBC | (5.024) |
| 13.420 | Avid Technology Inc | Barclays Bank | 45.628 | (13.779) | Axos Financial Inc | Morgan Stanley | 14.192 |
| 6.452 | Avidity Biosciences Inc | Goldman Sachs | (3.613) | (1.354) | Axsome Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.659 |
| (15.271) | AvidXchange Holdings Inc | Barclays Bank | 1.756 | (4.679) | Axsome Therapeutics Inc | Barclays Bank | 15.183 |
| (2.211) | Avient Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.881 | (200) | Axsome Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 649 |
| (17.609) | Avient Corp | Barclays Bank | 44.551 | (6.818) | AXT Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.318) |
| 7.136 | Avient Corp | Goldman Sachs | (18.982) | (8.001) | AXT Inc | Barclays Bank | (640) |
| 8.266 | Avient Corp | HSBC | (16.532) | (5.336) | AXT Inc | Goldman Sachs | (1.814) |
| (7.067) | Avient Corp | HSBC | 14.601 | (9.585) | AXT Inc | Morgan Stanley | (767) |
| (4.270) | Avient Corp | Morgan Stanley | 10.803 | (23.733) | AZEK Co Inc | Barclays Bank | 17.562 |
| (1.783) | Avis Budget Group Inc | Goldman Sachs | (4.885) | (17.307) | AZEK Co Inc | Goldman Sachs | 29.076 |
| (9.394) | Avista Corp | Bank of America Merrill Lynch | 10.144 | 21.664 | AZEK Co Inc | Goldman Sachs | (20.917) |
| (1.961) | Avista Corp | Barclays Bank | 1.174 | 4.984 | AZEK Co Inc | Morgan Stanley | (3.688) |
| (541) | Avista Corp | HSBC | 1.488 | (2.881) | Azenta Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.403) |
| (577) | Avista Corp | Morgan Stanley | 502 | 1.555 | Azenta Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.401 |
| (10.143) | Avita Medical Inc | Barclays Bank | 101 | (2.458) | Azenta Inc | Barclays Bank | 836 |
| (1.359) | Avita Medical Inc | HSBC | 6.265 | (4.849) | Azenta Inc | Goldman Sachs | (13.723) |
| (5.833) | Avnet Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16.391) | (728) | Azenta Inc | HSBC | 1.434 |
| (14.730) | Avnet Inc | Barclays Bank | (23.273) | (4.454) | Azenta Inc | Morgan Stanley | 1.514 |
| (4.806) | Avnet Inc | Goldman Sachs | (13.505) | (23.924) | AZZ Inc | Barclays Bank | 23.206 |
| (1.910) | Avnet Inc | HSBC | (5.329) | (8.516) | AZZ Inc | Goldman Sachs | 4.258 |
| (690) | Avnet Inc | Morgan Stanley | (1.090) | (10.780) | AZZ Inc | HSBC | 5.713 |
| | | | | (26.266) | B&G Foods Inc | Barclays Bank | 3.940 |
| | | | | (1.334) | B&G Foods Inc | HSBC | 3.295 |
| | | | | (8.065) | B&G Foods Inc | Morgan Stanley | 1.210 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (27.473) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | 15.660 | 13.445 | Bank of Marin Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 15.731 |
| (18.729) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Barclays Bank | 13.859 | 15.119 | Bank of Marin Bancorp | Barclays Bank | (9.071) |
| (16.956) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Goldman Sachs | 9.665 | 9.991 | Bank of Marin Bancorp | Goldman Sachs | 11.689 |
| (47.608) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | HSBC | 53.797 | 4.108 | Bank of Marin Bancorp | HSBC | 8.462 |
| (12.281) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Morgan Stanley | 9.088 | 17.446 | Bank of Marin Bancorp | Morgan Stanley | (10.468) |
| 6.649 | Backblaze Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.330) | 16.254 | Bank of New York Mellon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (5.039) |
| 13.982 | Backblaze Inc 'A' | Barclays Bank | (1.258) | 23.360 | Bank of New York Mellon Corp | Barclays Bank | (20.090) |
| 10.951 | Backblaze Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.190) | 33.616 | Bank of New York Mellon Corp | Goldman Sachs | (10.421) |
| 6.379 | Backblaze Inc 'A' | HSBC | (510) | 30.833 | Bank of New York Mellon Corp | HSBC | (34.225) |
| 7.804 | Backblaze Inc 'A' | Morgan Stanley | (702) | 1.471 | Bank of New York Mellon Corp | Morgan Stanley | (1.265) |
| 993 | Badger Meter Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.907 | 10.546 | Bank OZK | Bank of America Merrill Lynch | 2.213 |
| 707 | Badger Meter Inc | Barclays Bank | (990) | 9.196 | Bank OZK | Barclays Bank | (4.777) |
| 7.990 | Badger Meter Inc | Goldman Sachs | 15.269 | 2.916 | Bank OZK | Goldman Sachs | (106) |
| 1.191 | Badger Meter Inc | HSBC | 740 | 10.245 | Bank OZK | HSBC | 14.056 |
| 394 | Badger Meter Inc | Morgan Stanley | 123 | 916 | Bank OZK | Morgan Stanley | (403) |
| 2.820 | Baker Hughes Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.297) | 2.080 | Bank7 Corp | Barclays Bank | 530 |
| 2.130 | Baker Hughes Co | Goldman Sachs | (980) | 2.724 | Bank7 Corp | Goldman Sachs | 1.866 |
| 14.313 | Baker Hughes Co | HSBC | (6.567) | 11.171 | Bank7 Corp | HSBC | 168 |
| (20.752) | Bakkt Holdings Inc | HSBC | 311 | 961 | Bank7 Corp | Morgan Stanley | 245 |
| (15.496) | Balchem Corp | Barclays Bank | 16.426 | 56.083 | BankFinancial Corp | Goldman Sachs | 7.291 |
| (2.839) | Balchem Corp | Goldman Sachs | 9.227 | 27.098 | BankFinancial Corp | Morgan Stanley | 1.626 |
| (1.970) | Balchem Corp | HSBC | 8.629 | (257) | BankUnited Inc | Bank of America Merrill Lynch | (406) |
| (4.338) | Ball Corp | Bank of America Merrill Lynch | 15.409 | (6.045) | BankUnited Inc | Barclays Bank | 731 |
| (15.331) | Ball Corp | Barclays Bank | 45.744 | 2.746 | Bankwell Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 755 |
| (25.311) | Ball Corp | Goldman Sachs | 124.080 | 7.184 | Bankwell Financial Group Inc | Barclays Bank | (5.208) |
| (29.805) | Ball Corp | HSBC | 167.175 | 6.359 | Bankwell Financial Group Inc | Goldman Sachs | 1.749 |
| (19.408) | Ball Corp | Morgan Stanley | 59.000 | 1.513 | Bankwell Financial Group Inc | HSBC | 84 |
| 12.498 | Bally's Corp | Bank of America Merrill Lynch | (30.120) | 4.862 | Bankwell Financial Group Inc | Morgan Stanley | (3.525) |
| 7.916 | Bally's Corp | Barclays Bank | (17.732) | (1.877) | Banner Corp | Bank of America Merrill Lynch | (683) |
| 25.178 | Bally's Corp | Goldman Sachs | (60.679) | (4.901) | Banner Corp | Barclays Bank | 10.341 |
| 17.305 | Bally's Corp | HSBC | (47.070) | (1.309) | Banner Corp | HSBC | 223 |
| 9.140 | Bally's Corp | Morgan Stanley | (20.474) | (2.960) | Banner Corp | Morgan Stanley | 6.246 |
| (152) | BancFirst Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.765) | 4.699 | Bar Harbor Bankshares | Bank of America Merrill Lynch | 6.297 |
| (5.728) | BancFirst Corp | Barclays Bank | (12.086) | 26.914 | Bar Harbor Bankshares | Barclays Bank | (6.459) |
| (1.316) | BancFirst Corp | Goldman Sachs | (15.279) | 7.741 | Bar Harbor Bankshares | Goldman Sachs | 10.373 |
| (2.997) | BancFirst Corp | HSBC | (48.252) | 6.060 | Bar Harbor Bankshares | HSBC | 5.333 |
| (1.368) | BancFirst Corp | Morgan Stanley | (2.886) | 2.826 | Bar Harbor Bankshares | Morgan Stanley | (678) |
| 11.472 | Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA | Barclays Bank | (4.704) | 26.108 | BARK Inc | Bank of America Merrill Lynch | (392) |
| 3.050 | Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA | HSBC | 4.209 | 37.445 | BARK Inc | Barclays Bank | (7.302) |
| (21.267) | Bancorp Inc | Barclays Bank | (16.376) | 5.338 | BARK Inc | HSBC | (187) |
| (1.230) | Bancorp Inc | HSBC | (2.854) | 19.142 | BARK Inc | Morgan Stanley | (3.733) |
| (942) | Bancorp Inc | Morgan Stanley | (725) | (300) | Barnes & Noble Education Inc | HSBC | 66 |
| 17.243 | Bandwidth Inc 'A' | Barclays Bank | 7.070 | (53.333) | Barnes Group Inc | Barclays Bank | 81.066 |
| 747 | Bandwidth Inc 'A' | Goldman Sachs | 306 | (8.365) | Barnes Group Inc | Goldman Sachs | 6.943 |
| 1.625 | Bandwidth Inc 'A' | HSBC | 585 | (1.153) | Barnes Group Inc | HSBC | 1.510 |
| 5.453 | Bandwidth Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.236 | 2.129 | Barrett Business Services Inc | Barclays Bank | (1.533) |
| (8.600) | Bank First Corp | Barclays Bank | (37.496) | 1.785 | Barrett Business Services Inc | Goldman Sachs | 5.177 |
| (633) | Bank First Corp | HSBC | (5.039) | 8.003 | Bassett Furniture Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.361) |
| (13.135) | Bank First Corp | Morgan Stanley | (57.269) | 6.665 | Bassett Furniture Industries Inc | Barclays Bank | 600 |
| 2.506 | Bank of America Corp | Barclays Bank | (1.040) | | | | |
| 919 | Bank of America Corp | HSBC | 825 | | | | |
| (5.945) | Bank of America Corp | Morgan Stanley | 2.467 | | | | |
| 612 | Bank of Hawaii Corp | Bank of America Merrill Lynch | 42 | | | | |
| 648 | Bank of Hawaii Corp | Goldman Sachs | 103 | | | | |
| 3.622 | Bank of Hawaii Corp | HSBC | (12.061) | | | | |
| 1.985 | Bank of Hawaii Corp | Morgan Stanley | (1.511) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 5.755 | Bassett Furniture Industries Inc | Goldman Sachs | (978) | (1.669) | Bentley Systems Inc 'B' | Bank of America | (4.974) |
| 13.304 | Bassett Furniture Industries Inc | HSBC | (7.450) | (13.643) | Bentley Systems Inc 'B' | Merrill Lynch | (26.058) |
| (11.205) | Bath & Body Works Inc | Bank of America | | (693) | Bentley Systems Inc 'B' | Goldman Sachs | (2.065) |
| (7.503) | Bath & Body Works Inc | Merrill Lynch | 7.482 | (5.405) | Bentley Systems Inc 'B' | HSBC | (22.269) |
| (4.119) | Bath & Body Works Inc | Barclays Bank | 18.407 | (15.049) | Bentley Systems Inc 'B' | Morgan Stanley | (15.050) |
| (15.600) | Bath & Body Works Inc | Goldman Sachs | (7.785) | (422) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Bank of America | |
| (8.645) | Bath & Body Works Inc | HSBC | 26.095 | (9.092) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Merrill Lynch | 1.380 |
| (17.905) | Bausch Health Cos Inc | Morgan Stanley | 22.775 | (3.732) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Barclays Bank | 80.646 |
| 4.472 | Baxter International Inc | HSBC | (39.212) | (832) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Goldman Sachs | 12.204 |
| 7.849 | BayCom Corp | HSBC | (12.336) | (1.698) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | HSBC | 4.892 |
| 1.716 | BayCom Corp | Barclays Bank | 314 | (1.202) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Morgan Stanley | 15.061 |
| 1.034 | BayCom Corp | Goldman Sachs | 1.888 | 25.785 | Berkshire Hills Bancorp Inc | HSBC | (2.160) |
| (12.437) | BCB Bancorp Inc | Morgan Stanley | (166) | 37.785 | Berry Corp | Bank of America | |
| (21.416) | BCB Bancorp Inc | Bank of America | | 15.558 | Berry Corp | Merrill Lynch | (15.213) |
| (19.356) | BCB Bancorp Inc | Merrill Lynch | (8.333) | 12.625 | Berry Corp | Barclays Bank | (25.694) |
| (19.718) | BCB Bancorp Inc | Barclays Bank | 5.782 | (3.291) | Berry Corp | Goldman Sachs | (9.179) |
| (9.221) | BCB Bancorp Inc | Goldman Sachs | (12.969) | (10.703) | Berry Global Group Inc | HSBC | (8.459) |
| (4.337) | Beacon Roofing Supply Inc | HSBC | (4.930) | (1.248) | Berry Global Group Inc | Bank of America | |
| (11.938) | Beacon Roofing Supply Inc | Morgan Stanley | 2.490 | (2.654) | Berry Global Group Inc | Merrill Lynch | 6.264 |
| (17.195) | Beacon Roofing Supply Inc | Bank of America | | 1.946 | Best Buy Co Inc | Barclays Bank | 23.214 |
| (9.738) | Beacon Roofing Supply Inc | Merrill Lynch | (13.575) | 11.596 | Best Buy Co Inc | Goldman Sachs | 2.512 |
| (5.526) | Beacon Roofing Supply Inc | Barclays Bank | (3.566) | 13.354 | Best Buy Co Inc | Morgan Stanley | 5.278 |
| 4.988 | Beam Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (60.355) | 11.554 | Best Buy Co Inc | Bank of America | |
| 6.227 | Beam Therapeutics Inc | HSBC | (27.008) | 6.834 | Best Buy Co Inc | Merrill Lynch | 117 |
| 5.963 | Beam Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.508 | (6.689) | Beyond Air Inc | Barclays Bank | 28.294 |
| 14.195 | Beam Therapeutics Inc | Bank of America | | (19.822) | BGC Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 801 |
| 9.301 | Beam Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (19.453) | (96.629) | BGC Partners Inc 'A' | HSBC | 3.467 |
| (45.935) | Beauty Health Co | Barclays Bank | (19.055) | (45.051) | BGC Partners Inc 'A' | Morgan Stanley | 16.675 |
| (26.419) | Beauty Health Co | Goldman Sachs | (23.255) | (83.976) | BGC Partners Inc 'A' | Bank of America | 1.605 |
| (9.607) | Beauty Health Co | HSBC | (17.887) | (4.504) | BGSF Inc | Barclays Bank | 12.191 |
| (13.516) | Beauty Health Co | Morgan Stanley | (28.461) | (14.893) | BGSF Inc | Goldman Sachs | (2.545) |
| (7.886) | Beauty Health Co | Bank of America | | (4.705) | BGSF Inc | Merrill Lynch | (3.798) |
| 8.722 | Beazer Homes USA Inc | Merrill Lynch | 138.264 | 3.177 | Big 5 Sporting Goods Corp | Goldman Sachs | (2.658) |
| 7.035 | Beazer Homes USA Inc | Barclays Bank | 65.255 | 3.522 | Big 5 Sporting Goods Corp | Barclays Bank | (762) |
| 13.297 | Beazer Homes USA Inc | Goldman Sachs | 28.917 | 2.658 | Big 5 Sporting Goods Corp | Goldman Sachs | (2.043) |
| 1.562 | Beazer Homes USA Inc | HSBC | 40.413 | 10.539 | Big 5 Sporting Goods Corp | HSBC | (452) |
| (4.453) | Becton Dickinson & Co | Morgan Stanley | (62) | 34.554 | Big Lots Inc | Morgan Stanley | (2.529) |
| (1.960) | Becton Dickinson & Co | Bank of America | | (16.305) | BigCommerce Holdings Inc | Bank of America | |
| (3.613) | Becton Dickinson & Co | Merrill Lynch | 54.549 | (3.677) | BigCommerce Holdings Inc | Merrill Lynch | 1.467 |
| 4.291 | Bel Fuse Inc 'B' | HSBC | 24.833 | (24.520) | BigCommerce Holdings Inc | Barclays Bank | 2.942 |
| 230 | Belden Inc | Morgan Stanley | 44.115 | 45 | Biglari Holdings Inc 'A' | HSBC | (9.808) |
| 9.701 | Belden Inc | Barclays Bank | 4.119 | 137 | Biglari Holdings Inc 'A' | Bank of America | |
| 5.066 | Belden Inc | Merrill Lynch | 1.146 | 50 | Biglari Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | 4.063 |
| 1.013 | Belden Inc | Barclays Bank | 19.752 | 221 | Biglari Holdings Inc 'B' | Goldman Sachs | 12.369 |
| 215 | Belden Inc | Goldman Sachs | 24.925 | (353) | BILL Holdings Inc | Morgan Stanley | 3.692 |
| (989) | BellRing Brands Inc | HSBC | 2.028 | (309) | BILL Holdings Inc | Barclays Bank | 3.043 |
| (10.425) | BellRing Brands Inc | Morgan Stanley | 648 | (1.497) | BILL Holdings Inc | Barclays Bank | (191) |
| 7.635 | BellRing Brands Inc | Bank of America | | (2.387) | BILL Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.199) |
| (9.361) | BellRing Brands Inc | Merrill Lynch | (445) | (19.088) | BioCryst Pharmaceuticals Inc | HSBC | (5.371) |
| (3.468) | BellRing Brands Inc | Barclays Bank | (6.556) | (32.138) | BioCryst Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.289) |
| (732) | BellRing Brands Inc | Barclays Bank | 9.238 | (9.516) | BioCryst Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 10.403 |
| 6.031 | BellRing Brands Inc | Goldman Sachs | (4.653) | (439) | Biogen Inc | Goldman Sachs | 23.943 |
| 30.615 | Benchmark Electronics Inc | HSBC | (2.457) | (205) | Biohaven Ltd | HSBC | 4.425 |
| 28.078 | Benchmark Electronics Inc | Morgan Stanley | (886) | (15.804) | Biohaven Ltd | Bank of America | |
| 28.818 | Benchmark Electronics Inc | Barclays Bank | 7.298 | (4.048) | Biohaven Ltd | Merrill Lynch | 6.616 |
| 723 | Benchmark Electronics Inc | Goldman Sachs | 22.502 | (8.589) | BioLife Solutions Inc | Goldman Sachs | 3.089 |
| (6.473) | Benson Hill Inc | HSBC | 57.420 | (6.550) | BioLife Solutions Inc | Barclays Bank | (9.798) |
| (18.604) | Benson Hill Inc | Morgan Stanley | 74.206 | | | HSBC | (9.513) |
| (47.415) | Benson Hill Inc | Goldman Sachs | 531 | | | Morgan Stanley | (5.325) |
| | | HSBC | 65 | | | Barclays Bank | (6.616) |
| | | Morgan Stanley | (3.721) | | | | |
| | | | 11.854 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 422 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Barclays Bank | (2.270) | 18.231 | Blade Air Mobility Inc | Bank of America | |
| 3.028 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (23.588) | | | Merrill Lynch | 547 |
| 1.950 | BioMarin Pharmaceutical Inc | HSBC | (16.673) | 30.523 | Blade Air Mobility Inc | Barclays Bank | (2.137) |
| 839 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | (4.514) | 15.312 | Blade Air Mobility Inc | Goldman Sachs | 459 |
| (3.186) | Biomea Fusion Inc | Morgan Stanley | (9.813) | 25.470 | Blade Air Mobility Inc | HSBC | 10.188 |
| 717 | BioNTech SE ADR | Morgan Stanley | (1.850) | 36.105 | Blade Air Mobility Inc | Morgan Stanley | (2.527) |
| (146) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Bank of America | | 3.255 | Block Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.060 | | | Merrill Lynch | 13.899 |
| (137) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Barclays Bank | 1.934 | 6.786 | Block Inc | Barclays Bank | 3.057 |
| (186) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.446 | 7.806 | Block Inc | Goldman Sachs | 33.332 |
| (213) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | HSBC | 2.440 | 10.588 | Block Inc | HSBC | 30.681 |
| (229) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.302 | 11.479 | Block Inc | Morgan Stanley | 3.682 |
| (25.432) | Bio-Techne Corp | Barclays Bank | 81.891 | (1.910) | Bloom Energy Corp 'A' | Bank of America | |
| (11.648) | Bio-Techne Corp | Goldman Sachs | 1.049 | | | Merrill Lynch | 132 |
| (9.846) | Bio-Techne Corp | HSBC | 12.603 | (36.899) | Bloom Energy Corp 'A' | Barclays Bank | 31.884 |
| (49.738) | Bioventus Inc 'A' | Bank of America | | 12.333 | Bloom Energy Corp 'A' | Barclays Bank | (11.223) |
| | | Merrill Lynch | (82.068) | (1.793) | Bloom Energy Corp 'A' | HSBC | (145) |
| (18.871) | Bioventus Inc 'A' | Barclays Bank | (14.908) | 10.044 | Bloom Energy Corp 'A' | Morgan Stanley | (9.140) |
| (2.618) | Bioventus Inc 'A' | HSBC | (5.052) | (1.261) | Bloomin' Brands Inc | Bank of America | |
| (7.232) | Bioventus Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.713) | | | Merrill Lynch | 482 |
| (22.041) | Bioxcel Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 152.744 | (2.806) | Bloomin' Brands Inc | Barclays Bank | 4.739 |
| (6.779) | Bird Global Inc 'A' | Bank of America | | (12.181) | Bloomin' Brands Inc | Goldman Sachs | (3.167) |
| | | Merrill Lynch | 4.492 | (8.055) | Bloomin' Brands Inc | HSBC | (2.980) |
| 2.251 | BJ's Restaurants Inc | Bank of America | | (1.659) | Bloomin' Brands Inc | Morgan Stanley | 1.863 |
| | | Merrill Lynch | (2.183) | (9.736) | Blue Bird Corp | Barclays Bank | 22.003 |
| 12.515 | BJ's Restaurants Inc | Barclays Bank | (19.398) | (85.555) | Blue Foundry Bancorp | Barclays Bank | (19.678) |
| 6.419 | BJ's Restaurants Inc | Goldman Sachs | (7.452) | (21.347) | Blue Foundry Bancorp | Goldman Sachs | (13.022) |
| 15.997 | BJ's Restaurants Inc | HSBC | (9.961) | (29.186) | Blue Foundry Bancorp | HSBC | (17.074) |
| 1.843 | BJ's Restaurants Inc | Morgan Stanley | (2.857) | 40.165 | Blue Owl Capital Inc | Barclays Bank | (4.217) |
| 5.404 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Bank of America | | 11.228 | Blue Owl Capital Inc | Goldman Sachs | (1.291) |
| | | Merrill Lynch | (48.690) | 20.611 | Blue Owl Capital Inc | HSBC | (3.607) |
| 2.944 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Barclays Bank | (22.640) | (1.775) | Blue Ridge Bankshares Inc | Barclays Bank | (89) |
| 6.338 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Goldman Sachs | (57.105) | (21.531) | Blue Ridge Bankshares Inc | Goldman Sachs | (22.392) |
| 2.244 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Morgan Stanley | (17.256) | (35.724) | Bluebird Bio Inc | Barclays Bank | 13.932 |
| 19.351 | Black Diamond Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.161 | (6.632) | Bluegreen Vacations Holding Corp | Bank of America | |
| 35.961 | Black Diamond Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.079) | (5.841) | Bluegreen Vacations Holding Corp | Merrill Lynch | (20.095) |
| 24.145 | Black Diamond Therapeutics Inc | HSBC | (483) | (3.348) | Bluegreen Vacations Holding Corp | Barclays Bank | 6.250 |
| 6.360 | Black Diamond Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 382 | (977) | Bluegreen Vacations Holding Corp | Goldman Sachs | (10.144) |
| 8.268 | Black Hills Corp | Bank of America | | (2.079) | Bluegreen Vacations Holding Corp | HSBC | (3.322) |
| | | Merrill Lynch | (33.322) | (734) | BlueLinx Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.225 |
| 2.831 | Black Hills Corp | Barclays Bank | (5.270) | (1.823) | BlueLinx Holdings Inc | Bank of America | |
| 7.388 | Black Hills Corp | Goldman Sachs | (33.542) | (3.682) | BlueLinx Holdings Inc | Merrill Lynch | (3.674) |
| 895 | Black Hills Corp | HSBC | (222) | (3.569) | BlueLinx Holdings Inc | Barclays Bank | (2.578) |
| (296) | Blackbaud Inc | Bank of America | | 18.360 | Blueprint Medicines Corp | HSBC | (39.821) |
| | | Merrill Lynch | (586) | 6.215 | Blueprint Medicines Corp | Morgan Stanley | (5.794) |
| (1.998) | Blackbaud Inc | Barclays Bank | 120 | 15.182 | Blueprint Medicines Corp | Barclays Bank | (1.102) |
| (4.077) | Blackbaud Inc | Goldman Sachs | (8.072) | 2.491 | Blueprint Medicines Corp | Goldman Sachs | 6.526 |
| 6.276 | BlackLine Inc | Bank of America | | | Bluerock Homes Trust Inc | HSBC | 22.621 |
| | | Merrill Lynch | (17.510) | 4.900 | Bluerock Homes Trust Inc | Bank of America | |
| 11.655 | BlackLine Inc | Barclays Bank | (43.823) | 1.086 | Bluerock Homes Trust Inc | Merrill Lynch | (1.246) |
| 3.271 | BlackLine Inc | Goldman Sachs | (9.126) | 4.635 | Bluerock Homes Trust Inc | Barclays Bank | (4.165) |
| (5.305) | Blackstone Inc | Bank of America | | 1.243 | Bluerock Homes Trust Inc | Goldman Sachs | (543) |
| | | Merrill Lynch | (11.034) | 523 | BM Technologies Inc | HSBC | (6.535) |
| (3.893) | Blackstone Inc | Goldman Sachs | (8.097) | (1.930) | Boeing Co | Morgan Stanley | (1.057) |
| (60.813) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America | | (213) | Boeing Co | Barclays Bank | (73) |
| | | Merrill Lynch | (44.393) | (2.063) | Boeing Co | Barclays Bank | 7.874 |
| (146.980) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | (2.939) | (1.185) | Boeing Co | Goldman Sachs | (547) |
| (14.443) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (10.543) | (7.471) | Bogota Financial Corp | HSBC | 793 |
| (64.548) | Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | (1.291) | 348 | Boise Cascade Co | Morgan Stanley | 4.255 |
| | | | | | | Barclays Bank | (75) |
| | | | | 9.909 | Boise Cascade Co | Bank of America | |
| | | | | 550 | Boise Cascade Co | Merrill Lynch | (532) |
| | | | | 4.812 | Boise Cascade Co | Barclays Bank | (29.826) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (1.291) |
| | | | | | | HSBC | (2.117) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.763 | Boise Cascade Co | Morgan Stanley | (5.307) | 35.862 | Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.869 |
| 403 | BOK Financial Corp | HSBC | 1.423 | 63.926 | Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT) | HSBC | 2.557 |
| 170 | Bolt Biotherapeutics Inc | Bank of America | | (57.881) | BrainStorm Cell Therapeutics Inc | Barclays Bank | 3.473 |
| 139 | Bolt Biotherapeutics Inc | Merrill Lynch | (37) | (8.367) | BrainStorm Cell Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.924) |
| 945 | Bolt Biotherapeutics Inc | Barclays Bank | (25) | 197.001 | Brandywine Realty Trust (REIT) | Barclays Bank | 27.580 |
| (105) | Booking Holdings Inc | HSBC | 104 | 143.644 | Brandywine Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 38.784 |
| (855) | Booking Holdings Inc | Barclays Bank | 21.756 | 14.879 | Brandywine Realty Trust (REIT) | Morgan Stanley | 2.083 |
| (419) | Booking Holdings Inc | Goldman Sachs | 146.727 | (7.427) | Braze Inc 'A' | Goldman Sachs | (18.122) |
| (559) | Booking Holdings Inc | HSBC | 69.139 | (3.327) | Braze Inc 'A' | HSBC | (13.108) |
| (1.286) | Boot Barn Holdings Inc | Goldman Sachs | 123.628 | (1.632) | Braze Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.877 |
| (3.890) | Boot Barn Holdings Inc | HSBC | (3.279) | 4.799 | Bridgebio Pharma Inc | Bank of America | |
| (934) | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Barclays Bank | 12.137 | 19.036 | Bridgebio Pharma Inc | Merrill Lynch | (6.143) |
| 6.378 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Barclays Bank | (4.726) | 16.250 | Bridgebio Pharma Inc | Barclays Bank | (2.606) |
| 19.659 | BorgWarner Inc | Morgan Stanley | 32.273 | 3.772 | Bridgebio Pharma Inc | Goldman Sachs | (20.800) |
| (801) | BorgWarner Inc | Barclays Bank | (55.832) | (38.549) | Bridgewater Bancshares Inc | HSBC | (134) |
| (495) | BorgWarner Inc | Barclays Bank | 1.649 | (40.585) | Bridgewater Bancshares Inc | Goldman Sachs | (28.004) |
| (1.021) | BorgWarner Inc | Goldman Sachs | 1.169 | (10.110) | Bridgewater Bancshares Inc | HSBC | (4.853) |
| 29.582 | Borr Drilling Ltd | HSBC | 1.942 | (262) | Bridgford Foods Corp | Bank of America | |
| 24.214 | Borr Drilling Ltd | Barclays Bank | (7.396) | (6.472) | Bridgford Foods Corp | Merrill Lynch | 13 |
| 3.924 | Borr Drilling Ltd | Goldman Sachs | (1.336) | (3.165) | Bridgford Foods Corp | Barclays Bank | 971 |
| 27.446 | Borr Drilling Ltd | HSBC | (275) | (299) | Bridgford Foods Corp | Goldman Sachs | 158 |
| 157 | Boston Beer Co Inc 'A' | Barclays Bank | (6.862) | (826) | Bridgford Foods Corp | HSBC | 141 |
| 178 | Boston Beer Co Inc 'A' | Morgan Stanley | 929 | 3.518 | Briggs & Stratton Corp** | Morgan Stanley | 124 |
| 9.823 | Boston Omaha Corp 'A' | Barclays Bank | 1.054 | 32.162 | Briggs & Stratton Corp* | Barclays Bank | — |
| 14.838 | Boston Omaha Corp 'A' | Bank of America | (11.412) | (3.116) | Bright Health Group Inc | Bank of America | |
| (4.452) | Boston Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | (29.676) | (366) | Bright Health Group Inc | Merrill Lynch | 531 |
| (38.530) | Boston Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 78 | (1.242) | Bright Horizons Family Solutions Inc | HSBC | (377) |
| (12.370) | Boston Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 43.539 | 2.569 | Bright Horizons Family Solutions Inc | Bank of America | |
| (39.370) | Boston Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (7.537) | (478) | Bright Horizons Family Solutions Inc | Merrill Lynch | 2.658 |
| (20.830) | Boston Properties Inc (REIT) | HSBC | 59.279 | 21.254 | Brightcove Inc | Bank of America | |
| 44.883 | Boston Scientific Corp | Morgan Stanley | 23.538 | 31.382 | Brightcove Inc | Merrill Lynch | 13.921 |
| 57.391 | Boston Scientific Corp | Bank of America | (137.790) | 58.666 | Brightcove Inc | Barclays Bank | (3.923) |
| 58.990 | Boston Scientific Corp | Merrill Lynch | (176.191) | 23.429 | Brightcove Inc | Goldman Sachs | 38.426 |
| 27.287 | Boston Scientific Corp | Barclays Bank | (181.099) | 33.422 | Brightcove Inc | HSBC | 10.660 |
| 68.247 | Boston Scientific Corp | Goldman Sachs | (68.490) | 10.278 | Brighthouse Financial Inc | Morgan Stanley | (4.178) |
| (9.068) | Bowlero Corp | HSBC | (209.519) | 18.806 | Brighthouse Financial Inc | Bank of America | |
| (13.059) | Bowlero Corp | Morgan Stanley | 18.453 | 1.267 | Brighthouse Financial Inc | Merrill Lynch | (2.055) |
| (4.059) | Bowlero Corp | Barclays Bank | 34.802 | 16.939 | Brighthouse Financial Inc | Barclays Bank | (20.122) |
| 2.418 | Bowman Consulting Group Ltd | Goldman Sachs | 1.157 | 16.705 | Brighthouse Financial Inc | Goldman Sachs | (253) |
| 614 | Bowman Consulting Group Ltd | HSBC | (2.007) | 7.446 | BrightSphere Investment Group Inc | HSBC | (50.817) |
| 602 | Bowman Consulting Group Ltd | Bank of America | (107) | 3.335 | BrightSphere Investment Group Inc | Morgan Stanley | (17.875) |
| 7.353 | Box Inc 'A' | Merrill Lynch | 12.279 | 5.420 | BrightSphere Investment Group Inc | Bank of America | 1.340 |
| 26.774 | Box Inc 'A' | Barclays Bank | 26.507 | 10.359 | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Merrill Lynch | (12.638) |
| 50.237 | Box Inc 'A' | Goldman Sachs | 83.895 | 10.881 | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Bank of America | |
| 23.497 | Box Inc 'A' | HSBC | 42.294 | 5.186 | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Merrill Lynch | 5.658 |
| 15.592 | Boyd Gaming Corp | Bank of America | (45.476) | 36.081 | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.697 |
| 23.432 | Boyd Gaming Corp | Merrill Lynch | (57.034) | 90.714 | BrightSpire Capital Inc (REIT) | HSBC | 21.288 |
| 36.003 | Boyd Gaming Corp | Barclays Bank | (172.274) | | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | 5.443 |
| 28.167 | Boyd Gaming Corp | Goldman Sachs | (147.614) | | | | |
| 10.991 | Boyd Gaming Corp | HSBC | (22.323) | | | | |
| (24.075) | Brady Corp 'A' | Morgan Stanley | 77.281 | | | | |
| 61.236 | Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.674) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 35.092 | BrightView Holdings Inc | Barclays Bank | 702 | 20.478 | Brookline Bancorp Inc | Barclays Bank | (3.584) |
| 4.693 | BrightView Holdings Inc | Goldman Sachs | 986 | 46.583 | Brookline Bancorp Inc | Goldman Sachs | 23.524 |
| 16.923 | BrightView Holdings Inc | HSBC | 3.554 | 4.889 | Brookline Bancorp Inc | Morgan Stanley | (856) |
| 27.275 | BrightView Holdings Inc | Morgan Stanley | 546 | 1.789 | Brown & Brown Inc | Bank of America | |
| 2.350 | Brilliant Earth Group Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | |
| | | Merrill Lynch | (1.598) | (3.739) | Brown & Brown Inc | Barclays Bank | (1.489) |
| 15.430 | Brilliant Earth Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (10.492) | (15.168) | Brown & Brown Inc | Goldman Sachs | 12.900 |
| 2.133 | Brilliant Earth Group Inc 'A' | HSBC | (1.344) | (6.667) | Brown & Brown Inc | HSBC | 54.756 |
| 7.964 | Brilliant Earth Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (956) | 1.993 | Brown & Brown Inc | HSBC | 23.268 |
| (3.778) | Brinker International Inc | Bank of America | | (2.662) | Brown & Brown Inc | HSBC | (6.883) |
| | | Merrill Lynch | 6.271 | 893 | Brown & Brown Inc | Morgan Stanley | 9.184 |
| (6.036) | Brinker International Inc | Barclays Bank | 17.565 | (5.402) | Brown-Forman Corp 'B' | Morgan Stanley | (841) |
| (11.407) | Brinker International Inc | Goldman Sachs | 18.936 | | | Bank of America | |
| (5.477) | Brinker International Inc | HSBC | 2.903 | (8.469) | Brown-Forman Corp 'B' | Merrill Lynch | 12.843 |
| (3.753) | Brink's Co | Barclays Bank | 9.889 | (16.691) | Brown-Forman Corp 'B' | Barclays Bank | 23.883 |
| (5.653) | Brink's Co | HSBC | (13.103) | (4.288) | Brown-Forman Corp 'B' | Goldman Sachs | 37.559 |
| (481) | Brink's Co | Morgan Stanley | 1.072 | (21.414) | BRP Group Inc 'A' | HSBC | 13.336 |
| 3.363 | Bristol-Myers Squibb Co | Bank of America | | (4.484) | BRP Group Inc 'A' | Barclays Bank | 58.246 |
| | | Merrill Lynch | (14.898) | (3.703) | BRP Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 8.071 |
| 26.700 | Bristol-Myers Squibb Co | Barclays Bank | (55.269) | (15.877) | BRT Apartments Corp (REIT) | HSBC | 15.256 |
| 13.324 | Bristol-Myers Squibb Co | Goldman Sachs | (59.025) | | | Bank of America | |
| 38.605 | Bristol-Myers Squibb Co | HSBC | (180.286) | (17.104) | BRT Apartments Corp (REIT) | Merrill Lynch | (18.417) |
| 22.232 | Bristol-Myers Squibb Co | Morgan Stanley | (46.021) | | | Barclays Bank | (1.710) |
| (11.482) | Bristow Group Inc | Barclays Bank | (6.315) | (13.586) | BRT Apartments Corp (REIT) | | |
| (6.993) | Bristow Group Inc | Goldman Sachs | (12.098) | (5.738) | BRT Apartments Corp (REIT) | Goldman Sachs | (15.760) |
| (1.107) | Bristow Group Inc | Morgan Stanley | (609) | | | HSBC | (4.017) |
| 39.565 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Barclays Bank | (34.422) | 4.049 | Bruker Corp | Barclays Bank | (26.278) |
| 179.870 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | (215.844) | 2.486 | Bruker Corp | Goldman Sachs | (9.347) |
| 84.532 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | Morgan Stanley | (73.543) | 7.252 | Bruker Corp | HSBC | (61.642) |
| (9.132) | Broadcom Inc | Goldman Sachs | (1.510.433) | 1.643 | Brunswick Corp | Bank of America | |
| (814) | Broadcom Inc | Morgan Stanley | (103.240) | (3.026) | Brunswick Corp | Merrill Lynch | (3.007) |
| (4.568) | Broadridge Financial Solutions Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 37.695 | 3.212 | Brunswick Corp | Merrill Lynch | 5.538 |
| (6.692) | Broadridge Financial Solutions Inc | Barclays Bank | 52.130 | (2.801) | Brunswick Corp | Barclays Bank | (2.859) |
| (4.482) | Broadridge Financial Solutions Inc | Goldman Sachs | 37.820 | 8.326 | Brunswick Corp | Barclays Bank | 2.493 |
| (15.126) | Broadridge Financial Solutions Inc | HSBC | 99.265 | 6.170 | Brunswick Corp | Goldman Sachs | (15.237) |
| (8.951) | Broadridge Financial Solutions Inc | Morgan Stanley | 65.019 | (2.797) | Brunswick Corp | HSBC | (41.339) |
| 37.418 | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | Barclays Bank | (25.070) | 4.448 | Brunswick Corp | HSBC | 18.740 |
| 17.721 | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | HSBC | (17.544) | (3.252) | Brunswick Corp | Morgan Stanley | (3.959) |
| 29.790 | Brookdale Senior Living Inc | HSBC | (17.576) | (13.751) | Buckle Inc | Morgan Stanley | 2.894 |
| 11.821 | Brookdale Senior Living Inc | Morgan Stanley | (3.546) | (7.061) | Buckle Inc | Bank of America | 18.468 |
| 8.843 | Brookfield Business Corp 'A' | Barclays Bank | (22.284) | (3.240) | Buckle Inc | Barclays Bank | 7.482 |
| 790 | Brookfield Business Corp 'A' | Goldman Sachs | (758) | (27.299) | Buckle Inc | Goldman Sachs | 7.938 |
| 5.762 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | Barclays Bank | (4.091) | (13.991) | Buckle Inc | HSBC | 44.139 |
| 11.115 | Brookfield Infrastructure Corp 'A' | HSBC | 27.121 | (9.085) | Build-A-Bear Workshop Inc | Morgan Stanley | 14.470 |
| (21.889) | Brookfield Realty Capital Corp | Barclays Bank | (1.970) | | | Goldman Sachs | 28.799 |
| (41.179) | Brookfield Realty Capital Corp | HSBC | 2.059 | (1.570) | Builders FirstSource Inc | Bank of America | |
| 2.106 | Brookfield Renewable Corp 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (6.046) |
| | | Merrill Lynch | (5.644) | 2.167 | Builders FirstSource Inc | Goldman Sachs | (2.817) |
| 21.599 | Brookfield Renewable Corp 'A' | Barclays Bank | (42.334) | 3.531 | Builders FirstSource Inc | Morgan Stanley | (11.688) |
| 5.793 | Brookfield Renewable Corp 'A' | Goldman Sachs | (15.525) | 14.336 | Bumble Inc 'A' | Bank of America | |
| 35.146 | Brookfield Renewable Corp 'A' | HSBC | (73.104) | | | Merrill Lynch | (19.927) |
| 4.876 | Brookfield Renewable Corp 'A' | Morgan Stanley | (9.557) | 9.935 | Bumble Inc 'A' | Barclays Bank | (15.938) |
| | | | | 13.143 | Bumble Inc 'A' | Goldman Sachs | (18.265) |
| | | | | 25.747 | Bumble Inc 'A' | HSBC | (46.499) |
| | | | | 28.617 | Bumble Inc 'A' | Morgan Stanley | (48.649) |
| | | | | (10.164) | Bunge Ltd | Bank of America | |
| | | | | (6.862) | Bunge Ltd | Merrill Lynch | (8.436) |
| | | | | (13.435) | Bunge Ltd | Barclays Bank | (16.126) |
| | | | | (6.457) | Bunge Ltd | Goldman Sachs | (12.134) |
| | | | | (8.918) | Bunge Ltd | HSBC | (17.353) |
| | | | | 1.484 | Burford Capital Ltd | Morgan Stanley | (19.199) |
| | | | | 28.725 | Burford Capital Ltd | Barclays Bank | 183 |
| | | | | (1.151) | Burlington Stores Inc | HSBC | (8.618) |
| | | | | (822) | Burlington Stores Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 28.292 |
| | | | | | | Barclays Bank | 13.127 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 16.432 | Business First Bancshares Inc | Barclays Bank | (7.394) | (15.713) | Cadre Holdings Inc | Barclays Bank | 27.183 |
| 24.138 | Business First Bancshares Inc | Goldman Sachs | 9.172 | (1.736) | Cadre Holdings Inc | Morgan Stanley | 3.003 |
| 44.255 | Business First Bancshares Inc | HSBC | 8.408 | 9.013 | Caesars Entertainment Inc | Bank of America | (32.537) |
| 15.376 | Business First Bancshares Inc | Morgan Stanley | (6.919) | 24.433 | Caesars Entertainment Inc | Barclays Bank | (90.265) |
| (110.283) | Butterfly Network Inc | Barclays Bank | (23.159) | 4.410 | Caesars Entertainment Inc | Goldman Sachs | (15.920) |
| (8.382) | Butterfly Network Inc | Morgan Stanley | (1.760) | 35.543 | Caesars Entertainment Inc | HSBC | (157.811) |
| (21.216) | BWX Technologies Inc | Bank of America | | 26.109 | Caesars Entertainment Inc | Morgan Stanley | (99.475) |
| | | Merrill Lynch | 137.904 | 14.482 | Caesarstone Ltd | Bank of America | |
| (23.160) | BWX Technologies Inc | Barclays Bank | 129.001 | 14.874 | Caesarstone Ltd | Barclays Bank | (1.303) |
| (28.463) | BWX Technologies Inc | Goldman Sachs | 185.009 | 15.613 | Caesarstone Ltd | Goldman Sachs | 744 |
| (11.287) | BWX Technologies Inc | HSBC | 50.808 | 15.613 | Caesarstone Ltd | HSBC | (1.405) |
| (6.426) | BWX Technologies Inc | Morgan Stanley | 35.793 | 24.322 | Caesarstone Ltd | HSBC | 3.648 |
| 3.559 | Byline Bancorp Inc | Bank of America | | 29.823 | Caesarstone Ltd | Morgan Stanley | 1.491 |
| | | Merrill Lynch | 1.459 | (15.243) | CalAmp Corp | Barclays Bank | (1.219) |
| 16.902 | Byline Bancorp Inc | Barclays Bank | (4.902) | (19.984) | CalAmp Corp | Goldman Sachs | (799) |
| 45.644 | Byline Bancorp Inc | Goldman Sachs | 18.714 | 170 | Calavo Growers Inc | Bank of America | |
| 3.146 | Byline Bancorp Inc | HSBC | (126) | 4.668 | Calavo Growers Inc | Barclays Bank | 347 |
| (1.664) | Byrna Technologies Inc | Bank of America | | 4.898 | Calavo Growers Inc | Goldman Sachs | 9.992 |
| | | Merrill Lynch | 832 | 2.593 | Caledonia Mining Corp Plc | Barclays Bank | (2.437) |
| (44.408) | Byrna Technologies Inc | Barclays Bank | 30.642 | 5.877 | Caledonia Mining Corp Plc | Goldman Sachs | (7.699) |
| (3.876) | Byrna Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.938 | (5.537) | Caleres Inc | Bank of America | |
| (3.962) | Byrna Technologies Inc | HSBC | 1.307 | (10.492) | Caleres Inc | Merrill Lynch | 30.730 |
| (23.263) | Byrna Technologies Inc | Morgan Stanley | 16.051 | (7.575) | Caleres Inc | Barclays Bank | 34.414 |
| (2.352) | C&F Financial Corp | Barclays Bank | 3.610 | (16.659) | Caleres Inc | Goldman Sachs | 42.041 |
| (60) | C&F Financial Corp | Goldman Sachs | (12) | (11.011) | Caleres Inc | HSBC | 81.142 |
| 25.547 | C4 Therapeutics Inc | Barclays Bank | 5.876 | 1.311 | California BanCorp | Morgan Stanley | 36.116 |
| 5.579 | C4 Therapeutics Inc | Goldman Sachs | — | | | Bank of America | |
| 22.925 | C4 Therapeutics Inc | HSBC | 3.058 | 9.475 | California BanCorp | Merrill Lynch | 1.147 |
| (3.424) | Cabaletta Bio Inc | Morgan Stanley | 4.931 | 5.265 | California BanCorp | Barclays Bank | 2.795 |
| 222 | Cable One Inc | Bank of America | | 3.482 | California BanCorp | Goldman Sachs | 4.607 |
| | | Merrill Lynch | (6.278) | 1.897 | California BanCorp | HSBC | 2.524 |
| 421 | Cable One Inc | Barclays Bank | (18.052) | 2.397 | California BanCorp | Morgan Stanley | 560 |
| 180 | Cable One Inc | Goldman Sachs | (8.198) | 2.397 | California Resources Corp | Bank of America | |
| 86 | Cable One Inc | HSBC | (3.688) | 12.369 | California Resources Corp | Merrill Lynch | (5.729) |
| 270 | Cable One Inc | Morgan Stanley | (5.129) | 19.751 | California Resources Corp | Barclays Bank | (28.201) |
| 3.998 | Cabot Corp | Bank of America | | 4.996 | California Resources Corp | Goldman Sachs | (47.205) |
| | | Merrill Lynch | (880) | 3.346 | California Resources Corp | HSBC | (11.291) |
| 13.534 | Cabot Corp | Barclays Bank | (42.496) | 20.127 | California Resources Corp | Morgan Stanley | (7.629) |
| 5.617 | Cabot Corp | Goldman Sachs | (1.236) | 20.127 | California Water Service Group | Bank of America | |
| 4.249 | Cabot Corp | HSBC | (6.289) | 22.007 | California Water Service Group | Merrill Lynch | (4.227) |
| 9.061 | Cabot Corp | Morgan Stanley | (28.452) | 6.447 | California Water Service Group | Barclays Bank | 20.687 |
| 412 | CACI International Inc 'A' | Barclays Bank | (696) | | California Water Service Group | HSBC | (1.354) |
| 461 | CACI International Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.600) | 8.342 | California Water Service Group | | |
| 375 | CACI International Inc 'A' | HSBC | (1.264) | 53 | Calithera Biosciences Inc | Morgan Stanley | 7.841 |
| 525 | CACI International Inc 'A' | Morgan Stanley | (887) | 2.829 | Calix Inc | Goldman Sachs | 17 |
| (13.268) | Cactus Inc 'A' | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 48.959 | 7.872 | Calix Inc | Merrill Lynch | 2.035 |
| (57.998) | Cactus Inc 'A' | Barclays Bank | 200.574 | 10.045 | Calix Inc | Barclays Bank | (5.825) |
| (40.606) | Cactus Inc 'A' | HSBC | 244.385 | 8.458 | Calix Inc | Goldman Sachs | 10.246 |
| (35.979) | Cactus Inc 'A' | Morgan Stanley | 129.524 | 9.902 | Calix Inc | HSBC | 21.756 |
| (3.022) | Cadence Bank | Bank of America | | 1.186 | Callon Petroleum Co | Morgan Stanley | (7.328) |
| | | Merrill Lynch | (1.269) | | | Bank of America | |
| (55.484) | Cadence Bank | Barclays Bank | 46.052 | 22.880 | Callon Petroleum Co | Merrill Lynch | (1.755) |
| (19.107) | Cadence Bank | HSBC | (3.057) | 9.102 | Callon Petroleum Co | Barclays Bank | (55.141) |
| (18.393) | Cadence Bank | Morgan Stanley | 12.364 | 2.726 | Callon Petroleum Co | Goldman Sachs | (8.568) |
| 799 | Cadence Design Systems Inc | Bank of America | | 8.187 | Cal-Maine Foods Inc | HSBC | (13.024) |
| | | Merrill Lynch | 3.989 | | | Bank of America | |
| 909 | Cadence Design Systems Inc | Morgan Stanley | 6.998 | 7.907 | Cal-Maine Foods Inc | Merrill Lynch | 5.322 |
| (4.363) | Cadiz Inc | Bank of America | | 1.225 | Cal-Maine Foods Inc | Barclays Bank | (6.247) |
| | | Merrill Lynch | (4.363) | 4.948 | Cambium Networks Corp | Goldman Sachs | 796 |
| (23.544) | Cadiz Inc | Barclays Bank | (6.357) | | | Bank of America | |
| (36.684) | Cadiz Inc | HSBC | (17.975) | 8.761 | Cambium Networks Corp | Merrill Lynch | 4.849 |
| (30.820) | Cadiz Inc | Morgan Stanley | (8.321) | 4.914 | Cambium Networks Corp | Barclays Bank | (175) |
| (6.566) | Cadre Holdings Inc | Bank of America | | 4.108 | Cambium Networks Corp | Goldman Sachs | 4.816 |
| | | Merrill Lynch | 5.778 | 12.726 | Cambium Networks Corp | HSBC | 5.721 |
| | | | | | | Morgan Stanley | (255) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (5.488) | Cambridge Bancorp | Barclays Bank | 5.232 | (34.366) | Cara Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (10.772) | Cambridge Bancorp | Goldman Sachs | (33.178) | | | Merrill Lynch | 27.836 |
| (6.659) | Cambridge Bancorp | HSBC | (21.842) | (24.366) | Cara Therapeutics Inc | Barclays Bank | 9.015 |
| (2.799) | Cambridge Bancorp | Morgan Stanley | 2.603 | (4.465) | Cara Therapeutics Inc | HSBC | 4.197 |
| 20.207 | Camden National Corp | Barclays Bank | (20.409) | (31.489) | Cardiff Oncology Inc | Bank of America | |
| 1.267 | Camden National Corp | Goldman Sachs | 1.381 | | | Merrill Lynch | 4.094 |
| 1.787 | Camden Property Trust (REIT) | Bank of America | | (6.154) | Cardiff Oncology Inc | Barclays Bank | 431 |
| | | Merrill Lynch | (7.595) | (8.947) | Cardiff Oncology Inc | Goldman Sachs | 1.163 |
| 14.542 | Camden Property Trust (REIT) | Barclays Bank | (24.430) | (7.320) | Cardiff Oncology Inc | HSBC | 1.318 |
| 19.250 | Camden Property Trust (REIT) | Goldman Sachs | (81.813) | 5.729 | Cardinal Health Inc | Bank of America | |
| 10.290 | Camden Property Trust (REIT) | HSBC | (64.518) | 19.850 | Cardinal Health Inc | Merrill Lynch | (22.630) |
| 5.328 | Camden Property Trust (REIT) | Morgan Stanley | (8.951) | (2.358) | Cardinal Health Inc | Barclays Bank | (91.509) |
| 7.514 | Campbell Soup Co | Bank of America | | 5.896 | Cardinal Health Inc | Barclays Bank | 10.870 |
| | | Merrill Lynch | (22.129) | (617) | Cardinal Health Inc | HSBC | (16.391) |
| 39.011 | Campbell Soup Co | Barclays Bank | (47.008) | (5.725) | Cardinal Health Inc | HSBC | 1.715 |
| 33.470 | Campbell Soup Co | Goldman Sachs | (98.569) | 4.176 | Cardlytics Inc | Morgan Stanley | 26.392 |
| 1.790 | Campbell Soup Co | HSBC | (7.294) | 5.112 | Cardlytics Inc | Barclays Bank | (919) |
| 9.754 | Campbell Soup Co | Morgan Stanley | (11.753) | 7.292 | Cardlytics Inc | HSBC | (1.687) |
| (36.082) | Camping World Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (36.443) | 2.947 | CareDx Inc | Morgan Stanley | (1.604) |
| (5.782) | Camping World Holdings Inc 'A' | HSBC | (13.125) | 8.868 | CareDx Inc | Bank of America | (1.415) |
| (14.609) | Camping World Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (14.755) | 7.551 | CareDx Inc | Goldman Sachs | (4.257) |
| (1.512) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Barclays Bank | 7.560 | 19.237 | CareDx Inc | HSBC | (2.643) |
| (1.099) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Goldman Sachs | 7.242 | 9.570 | CareMax Inc | Morgan Stanley | (13.274) |
| (8.816) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Morgan Stanley | 44.080 | 26.652 | CareMax Inc | Bank of America | |
| (4.538) | Cannae Holdings Inc | Bank of America | | 10.474 | CareMax Inc | Merrill Lynch | (191) |
| | | Merrill Lynch | (6.535) | 7.357 | CareMax Inc | Barclays Bank | (9.328) |
| (23.656) | Cannae Holdings Inc | Barclays Bank | 3.548 | (10.061) | CareTrust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (209) |
| (32.384) | Cannae Holdings Inc | Goldman Sachs | (46.633) | (34.219) | CareTrust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (2.575) |
| (24.862) | Cannae Holdings Inc | HSBC | (40.525) | (35.451) | CareTrust Inc (REIT) | Bank of America | |
| (32.372) | Cano Health Inc | Bank of America | | (36.168) | CareTrust Inc (REIT) | Merrill Lynch | 11.671 |
| | | Merrill Lynch | (971) | (3.458) | CareTrust Inc (REIT) | Barclays Bank | 16.767 |
| 2.210 | Cantaloupe Inc | Barclays Bank | 3.548 | 2.460 | Cargurus Inc | Goldman Sachs | 41.123 |
| 6.047 | Cantaloupe Inc | Goldman Sachs | (46.633) | | | HSBC | 40.508 |
| 29.626 | Cantaloupe Inc | HSBC | (40.525) | | | Morgan Stanley | 1.694 |
| (6.153) | Capital Bancorp Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| (3.251) | Capital Bancorp Inc | Merrill Lynch | (971) | | | Merrill Lynch | (763) |
| 33.851 | Capital City Bank Group Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.100 |
| 35.842 | Capital City Bank Group Inc | Merrill Lynch | (663) | | | Goldman Sachs | 1.085 |
| 9.832 | Capital City Bank Group Inc | Barclays Bank | (2.056) | | | HSBC | (3.025) |
| (2.996) | Capital One Financial Corp | Goldman Sachs | (8.888) | | | Morgan Stanley | 878 |
| | | Barclays Bank | 4.184 | | | Bank of America | |
| (11.571) | Capital One Financial Corp | Goldman Sachs | (2.731) | | | Merrill Lynch | 12.927 |
| (197) | Capital One Financial Corp | Barclays Bank | (3.385) | | | HSBC | 1.185 |
| (9.776) | Capital One Financial Corp | Goldman Sachs | 28.674 | | | Barclays Bank | (7.709) |
| (10.183) | Capital One Financial Corp | HSBC | 5.998 | | | Goldman Sachs | 1.116 |
| (10.391) | Capitol Federal Financial Inc | Bank of America | | | | HSBC | 9.982 |
| | | Merrill Lynch | (40.151) | | | Barclays Bank | — |
| (109.050) | Capitol Federal Financial Inc | Barclays Bank | (4.362) | | | Goldman Sachs | (5.698) |
| (69.675) | Capitol Federal Financial Inc | Goldman Sachs | (32.051) | | | HSBC | 6.015 |
| (101.750) | Capitol Federal Financial Inc | HSBC | (46.805) | | | Morgan Stanley | — |
| (17.653) | Capitol Federal Financial Inc | Morgan Stanley | (706) | | | Bank of America | |
| (14.541) | Capri Holdings Ltd | Barclays Bank | 45.662 | | | Merrill Lynch | 8.946 |
| (6.649) | Capri Holdings Ltd | Goldman Sachs | 25.732 | | | HSBC | 57.056 |
| (13.584) | Capri Holdings Ltd | HSBC | 40.261 | | | Bank of America | |
| (25.280) | Capri Holdings Ltd | Morgan Stanley | 79.114 | | | Merrill Lynch | 4.385 |
| 27.492 | Capstar Financial Holdings Inc | Barclays Bank | (13.471) | | | Barclays Bank | 2.246 |
| 4.599 | Capstar Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.300 | | | Goldman Sachs | 105.605 |
| | | | | | | HSBC | 2.166 |
| | | | | | | Morgan Stanley | 1.173 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (4.830) | Carriage Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.950 | (2.930) | Cathay General Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (1.090) |
| (16.102) | Carriage Services Inc | Barclays Bank | 24.958 | (46.381) | Cathay General Bancorp | Barclays Bank | 44.526 |
| (3.466) | Carriage Services Inc | Morgan Stanley | 5.372 | (2.763) | Cathay General Bancorp | HSBC | (1.882) |
| (32.361) | Carrier Global Corp | Barclays Bank | 44.658 | (25.836) | Cathay General Bancorp | Morgan Stanley | 25.412 |
| (21.184) | Carrier Global Corp | Goldman Sachs | 37.284 | (21.326) | Cato Corp 'A' | Goldman Sachs | (6.185) |
| 63.542 | Carrols Restaurant Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 936 | (5.622) | Cato Corp 'A' | HSBC | (731) |
| 6.251 | Carrols Restaurant Group Inc | Barclays Bank | (2.750) | (236) | Cavco Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.423 |
| 14.274 | Carrols Restaurant Group Inc | Goldman Sachs | (1.066) | (1.072) | Cavco Industries Inc | Barclays Bank | 31.067 |
| 5.450 | Carrols Restaurant Group Inc | HSBC | 1.504 | (1.467) | Cavco Industries Inc | Goldman Sachs | 58.577 |
| (12.538) | Cars.com Inc | Goldman Sachs | 16.049 | (1.006) | Cavco Industries Inc | HSBC | 51.155 |
| (27.230) | Carter Bankshares Inc | Barclays Bank | 545 | (246) | Cavco Industries Inc | Morgan Stanley | 7.129 |
| (7.284) | Carter Bankshares Inc | Goldman Sachs | (4.443) | 7.430 | CB Financial Services Inc | Barclays Bank | 3.864 |
| (14.609) | Carter Bankshares Inc | HSBC | (11.541) | 4.379 | CB Financial Services Inc | Goldman Sachs | (2.321) |
| (3.680) | Carter's Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.287 | 1.841 | CB Financial Services Inc | Morgan Stanley | 957 |
| (21.955) | Carter's Inc | Barclays Bank | 52.253 | (6.574) | CBIZ Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.050) |
| (11.734) | Carter's Inc | Goldman Sachs | 23.233 | (6.024) | CBIZ Inc | Barclays Bank | 2.590 |
| (3.513) | Carter's Inc | HSBC | 21.359 | (5.122) | CBIZ Inc | Goldman Sachs | (2.817) |
| (3.480) | Carter's Inc | Morgan Stanley | 8.283 | (13.687) | CBIZ Inc | HSBC | 2.134 |
| 17.813 | Carvana Co | Barclays Bank | 25.473 | (2.421) | CBIZ Inc | Morgan Stanley | 778 |
| 7.186 | Casa Systems Inc | Morgan Stanley | (431) | (9.436) | CBL & Associates Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (4.057) |
| (5.104) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 14.853 | 3.386 | Cboe Global Markets Inc | Barclays Bank | (23.837) |
| (12.966) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Barclays Bank | 12.577 | 18.397 | Cboe Global Markets Inc | HSBC | (77.819) |
| (2.943) | Casella Waste Systems Inc 'A' | HSBC | (4.091) | (11.714) | CBRE Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 8.412 |
| (5.522) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.356 | (6.108) | CBRE Group Inc 'A' | Barclays Bank | 20.401 |
| 817 | Casey's General Stores Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.170) | (4.251) | CBRE Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 5.914 |
| 2.658 | Casey's General Stores Inc | Barclays Bank | (1.250) | (4.916) | CBRE Group Inc 'A' | HSBC | 16.143 |
| 1.236 | Casey's General Stores Inc | Goldman Sachs | (4.796) | (11.565) | CBRE Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 31.006 |
| 1.434 | Casey's General Stores Inc | HSBC | (1.520) | 3.304 | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.791 |
| 2.027 | Casey's General Stores Inc | Morgan Stanley | (953) | 10.557 | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | Barclays Bank | 9.923 |
| 7.714 | Cass Information Systems Inc | Barclays Bank | (1.543) | 2.597 | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.766 |
| (3.627) | Cassava Sciences Inc | Barclays Bank | 8.161 | 11.386 | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | HSBC | 20.267 |
| (5.468) | Castle Biosciences Inc | Barclays Bank | 574 | 15.700 | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley | 14.758 |
| (1.370) | Castle Biosciences Inc | Goldman Sachs | (1.973) | (5.248) | CDW Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6.297) |
| (4.058) | Castle Biosciences Inc | HSBC | (9.577) | (5.189) | CDW Corp | Barclays Bank | 16.086 |
| (2.997) | Castle Biosciences Inc | Morgan Stanley | 913 | (2.610) | CDW Corp | Goldman Sachs | (3.132) |
| (8.559) | Catalent Inc | Barclays Bank | 6.958 | (2.885) | CDW Corp | HSBC | (12.148) |
| (2.058) | Catalent Inc | Morgan Stanley | 2.202 | (10.974) | CDW Corp | Morgan Stanley | 34.020 |
| 22.484 | Catalyst | Bank of America Merrill Lynch | (19.506) | 16.113 | CECO Environmental Corp | Bank of America Merrill Lynch | (13.374) |
| 30.102 | Catalyst | Barclays Bank | 3.986 | 35.821 | CECO Environmental Corp | Barclays Bank | (45.851) |
| 3.322 | Catalyst | Goldman Sachs | (92) | 28.575 | CECO Environmental Corp | Goldman Sachs | (23.717) |
| 32.520 | Catalyst | HSBC | 4.307 | 2.309 | CECO Environmental Corp | Morgan Stanley | (2.956) |
| 23.842 | Catalyst | Morgan Stanley | 3.157 | (11.022) | Celanese Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6.997 |
| 22.484 | Catalyst Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 337 | (30.847) | Celanese Corp | Barclays Bank | 112.391 |
| 30.102 | Catalyst Biosciences Inc | Barclays Bank | — | (1.006) | Celanese Corp | HSBC | 1.197 |
| 3.322 | Catalyst Biosciences Inc | Goldman Sachs | 50 | (18.307) | Celanese Corp | Morgan Stanley | 67.370 |
| 32.520 | Catalyst Biosciences Inc | HSBC | 813 | (4.302) | Celcuity Inc | Barclays Bank | (86) |
| 23.842 | Catalyst Biosciences Inc | Morgan Stanley | — | (8.968) | Celldex Therapeutics Inc | Barclays Bank | 18.833 |
| 16.315 | Catalyst Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (14.928) | (1.301) | Celsius Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.823 |
| 428 | Caterpillar Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.772) | (6.699) | Celsius Holdings Inc | Barclays Bank | 48.300 |
| 1.064 | Caterpillar Inc | Barclays Bank | (7.565) | 235 | Celsius Holdings Inc | Goldman Sachs | (129) |
| 220 | Caterpillar Inc | Goldman Sachs | (911) | 735 | Celsius Holdings Inc | HSBC | 12.583 |
| 237 | Caterpillar Inc | HSBC | (1.811) | (768) | Celsius Holdings Inc | Morgan Stanley | 5.537 |
| 398 | Caterpillar Inc | Morgan Stanley | (2.830) | 248 | Celsius Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.788) |
| | | | | (13.694) | Centene Corp | Bank of America Merrill Lynch | 72.469 |
| | | | | (52.613) | Centene Corp | Barclays Bank | 189.407 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (11.707) | Centene Corp | HSBC | 73.272 | (2.802) | CF Industries Holdings Inc | Barclays Bank | 14.038 |
| (10.242) | Centene Corp | Morgan Stanley | 36.872 | (992) | CF Industries Holdings Inc | HSBC | 5.506 |
| 49.175 | CenterPoint Energy Inc | Bank of America | | (3.523) | CH Robinson Worldwide Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (66.627) | | | Merrill Lynch | 15.149 |
| 44.695 | CenterPoint Energy Inc | Barclays Bank | (23.688) | (20.353) | CH Robinson Worldwide Inc | Barclays Bank | 109.296 |
| 2.154 | CenterPoint Energy Inc | Goldman Sachs | (3.209) | (1.597) | CH Robinson Worldwide Inc | Goldman Sachs | 6.867 |
| 31.987 | CenterPoint Energy Inc | HSBC | (58.166) | (16.802) | CH Robinson Worldwide Inc | HSBC | 121.646 |
| 10.962 | CenterPoint Energy Inc | Morgan Stanley | (5.810) | (6.080) | CH Robinson Worldwide Inc | Morgan Stanley | 32.650 |
| (7.507) | Centerspace (REIT) | Barclays Bank | 2.252 | (25.830) | Champions Oncology Inc | Bank of America | |
| (3.052) | Centerspace (REIT) | HSBC | (671) | | | Merrill Lynch | (12.657) |
| 15.348 | Centogene NV | Barclays Bank | 46 | (2.364) | Champions Oncology Inc | Barclays Bank | 804 |
| 1.029 | Centogene NV | Goldman Sachs | (12) | 23.593 | ChampionX Corp | Bank of America | |
| 631 | Centogene NV | Morgan Stanley | 2 | | | Merrill Lynch | (22.177) |
| 20.485 | Central Garden & Pet Co 'A' | Barclays Bank | (6.146) | (1.403) | ChampionX Corp | Barclays Bank | 2.722 |
| 6.293 | Central Garden & Pet Co 'A' | Goldman Sachs | (3.147) | (7.215) | ChampionX Corp | Goldman Sachs | 6.782 |
| 30.948 | Central Pacific Financial Corp | Bank of America | | (3.772) | ChampionX Corp | HSBC | 6.337 |
| | | Merrill Lynch | 18.878 | 18.431 | ChampionX Corp | Morgan Stanley | (35.756) |
| 89.636 | Central Pacific Financial Corp | Morgan Stanley | (57.367) | (7.424) | ChargePoint Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (7.201) |
| (75) | Central Valley Community Bancorp | Merrill Lynch | (89) | (180.024) | ChargePoint Holdings Inc | Barclays Bank | (232.231) |
| (3.004) | Central Valley Community Bancorp | Barclays Bank | 2.103 | (3.335) | ChargePoint Holdings Inc | HSBC | (1.801) |
| (3.937) | Central Valley Community Bancorp | Goldman Sachs | (4.646) | (2.250) | Charles River Laboratories International Inc | Bank of America | |
| (6.587) | Central Valley Community Bancorp | HSBC | (3.425) | | | Merrill Lynch | 12.078 |
| (135) | Central Valley Community Bancorp | Morgan Stanley | 95 | (1.849) | Charles River Laboratories International Inc | Barclays Bank | 4.948 |
| (7.694) | Centrus Energy Corp 'A' | Barclays Bank | 25.313 | (2.650) | Charles River Laboratories International Inc | Goldman Sachs | (2.483) |
| 8.439 | Century Aluminum Co | Barclays Bank | (3.460) | (2.400) | Charles River Laboratories International Inc | Morgan Stanley | 9.708 |
| 2.194 | Century Aluminum Co | Goldman Sachs | 395 | (7.870) | Charles Schwab Corp | Bank of America | |
| 6.167 | Century Aluminum Co | HSBC | (3.947) | | | Merrill Lynch | (13.174) |
| 12.715 | Century Casinos Inc | Barclays Bank | (4.577) | (1.664) | Charles Schwab Corp | Barclays Bank | (578) |
| 16.497 | Century Casinos Inc | Goldman Sachs | 1.155 | (6.535) | Charles Schwab Corp | Goldman Sachs | (7.221) |
| 5.796 | Century Casinos Inc | Morgan Stanley | (2.087) | (1.675) | Charles Schwab Corp | HSBC | (3.847) |
| 5.375 | Century Communities Inc | Bank of America | | (15.694) | Charles Schwab Corp | Morgan Stanley | (15.502) |
| | | Merrill Lynch | (17.899) | (721) | Chart Industries Inc | Bank of America | |
| 6.279 | Century Communities Inc | Barclays Bank | (16.200) | | | Merrill Lynch | 3.555 |
| 343 | Century Communities Inc | Goldman Sachs | (1.142) | (3.384) | Chart Industries Inc | Barclays Bank | 31.336 |
| 4.404 | Century Communities Inc | Morgan Stanley | (11.362) | (2.380) | Chart Industries Inc | Goldman Sachs | 11.733 |
| 1.272 | Century Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (401) | (161) | Chart Industries Inc | HSBC | 2.731 |
| 1.768 | Cerence Inc | Barclays Bank | 6.648 | (3.772) | Chart Industries Inc | Morgan Stanley | 31.907 |
| 5.750 | Cerence Inc | Goldman Sachs | 28.290 | (969) | Charter Communications Inc 'A' | Bank of America | |
| 5.338 | Cerence Inc | HSBC | 13.078 | | | Merrill Lynch | 10.774 |
| 698 | Cerence Inc | Morgan Stanley | 2.624 | (2.389) | Charter Communications Inc 'A' | Barclays Bank | 26.375 |
| (7.260) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Bank of America | | (2.020) | Charter Communications Inc 'A' | Goldman Sachs | 25.836 |
| | | Merrill Lynch | (3.511) | (86) | Charter Communications Inc 'A' | HSBC | 248 |
| (12.854) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Barclays Bank | 16.582 | | | | |
| (8.046) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.828) | (2.770) | Charter Communications Inc 'A' | Morgan Stanley | 30.581 |
| (3.482) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.492 | (3.587) | Chase Corp | Bank of America | |
| (3.057) | Ceridian HCM Holding Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (21.396) |
| | | Merrill Lynch | (5.594) | (1.301) | Chase Corp | Barclays Bank | 1.958 |
| (1.737) | Ceridian HCM Holding Inc | Barclays Bank | 3.248 | (7.277) | Chase Corp | Goldman Sachs | (43.407) |
| (796) | Ceridian HCM Holding Inc | Goldman Sachs | (614) | (2.711) | Chase Corp | HSBC | (25.768) |
| (2.007) | Ceridian HCM Holding Inc | HSBC | (2.283) | (182) | Chase Corp | Morgan Stanley | 274 |
| (1.251) | Ceridian HCM Holding Inc | Morgan Stanley | 2.339 | 11.161 | Chatham Lodging Trust (REIT) | Bank of America | |
| (12.769) | Certara Inc | Bank of America | | 71.830 | Chatham Lodging Trust (REIT) | Merrill Lynch | (6.027) |
| | | Merrill Lynch | (10.854) | 65.025 | Chatham Lodging Trust (REIT) | Barclays Bank | (22.267) |
| (3.667) | Certara Inc | Goldman Sachs | (1.523) | | | Goldman Sachs | (35.114) |
| (15.227) | Certara Inc | HSBC | 33.347 | 27.567 | Chatham Lodging Trust (REIT) | | |
| (18.634) | Certara Inc | Morgan Stanley | (5.031) | | | Morgan Stanley | (8.546) |
| 22.324 | Cerus Corp | Barclays Bank | 1.228 | 2.498 | CHC Group Ltd' | Morgan Stanley | (1.124) |
| 60.890 | Cerus Corp | HSBC | (10.656) | (5.184) | Check Point Software Technologies Ltd | Bank of America | |
| 26.505 | Cerus Corp | Morgan Stanley | 1.458 | | | Merrill Lynch | (11.464) |
| (28.595) | CEVA Inc | Barclays Bank | (48.897) | 1.496 | Check Point Software Technologies Ltd | Bank of America | |
| (21.085) | CEVA Inc | Goldman Sachs | (55.032) | | | Merrill Lynch | 5.924 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.076) | Check Point Software Technologies Ltd | Barclays Bank | (4.337) | (125.337) | Chimera Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 16.294 |
| (6.076) | Check Point Software Technologies Ltd | Goldman Sachs | (24.061) | (46.215) | Chimera Investment Corp (REIT) | HSBC | 17.100 |
| (2.481) | Check Point Software Technologies Ltd | HSBC | (4.169) | (44.675) | Chimera Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 4.021 |
| (4.007) | Check Point Software Technologies Ltd | Morgan Stanley | (5.014) | (12.698) | Chimerix Inc | Bank of America | |
| (13.937) | Cheesecake Factory Inc | Bank of America | | (49.139) | Chimerix Inc | Merrill Lynch | (3.048) |
| | | Merrill Lynch | 418 | (62.335) | Chimerix Inc | Barclays Bank | 983 |
| (34.653) | Cheesecake Factory Inc | Barclays Bank | 61.682 | (66.116) | Chimerix Inc | Goldman Sachs | (14.960) |
| (15.511) | Cheesecake Factory Inc | HSBC | 29.936 | | | HSBC | (17.190) |
| (1.513) | Cheesecake Factory Inc | Morgan Stanley | 2.693 | 1.840 | Chinook Therapeutics Inc | Barclays Bank | 4.434 |
| (7.029) | Chefs' Warehouse Inc | Barclays Bank | 8.083 | 2.984 | Chinook Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 3.372 |
| (8.518) | Chefs' Warehouse Inc | HSBC | 31.006 | 4.665 | Chinook Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 11.243 |
| (2.640) | Chefs' Warehouse Inc | Morgan Stanley | 3.036 | (444) | Chipotle Mexican Grill Inc | Barclays Bank | 15.447 |
| 5.113 | Chegg Inc | Bank of America | | (768) | Chipotle Mexican Grill Inc | Goldman Sachs | (15.383) |
| | | Merrill Lynch | (2.480) | (89) | Chipotle Mexican Grill Inc | HSBC | (3.054) |
| 17.315 | Chegg Inc | HSBC | (16.016) | (312) | Chipotle Mexican Grill Inc | Morgan Stanley | 10.854 |
| 868 | Chemed Corp | Barclays Bank | (9.991) | (1.607) | Choice Hotels International Inc | Barclays Bank | 5.448 |
| 772 | Chemed Corp | Goldman Sachs | (12.259) | 2.337 | Choice Hotels International Inc | Goldman Sachs | (17.294) |
| 1.525 | Chemed Corp | HSBC | (36.371) | (2.536) | Choice Hotels International Inc | Morgan Stanley | 8.597 |
| 407 | Chemed Corp | Morgan Stanley | (4.685) | | | Bank of America | |
| 9.147 | Chemours Co | Bank of America | | 332 | ChoiceOne Financial Services Inc | Merrill Lynch | (65) |
| | | Merrill Lynch | (16.922) | 2.438 | ChoiceOne Financial Services Inc | Barclays Bank | (134) |
| 16.403 | Chemours Co | Barclays Bank | (32.970) | 4.291 | ChoiceOne Financial Services Inc | HSBC | (3.583) |
| 6.414 | Chemours Co | HSBC | (14.303) | 75 | ChoiceOne Financial Services Inc | Morgan Stanley | (4) |
| 12.002 | Chemours Co | Morgan Stanley | (24.124) | (2.159) | Chord Energy Corp | Bank of America | |
| 1.002 | Chemung Financial Corp | Bank of America | | 1.389 | Chord Energy Corp | Merrill Lynch | (5.225) |
| | | Merrill Lynch | 601 | (3.733) | Chord Energy Corp | Bank of America | |
| 4.898 | Cheniere Energy Inc | Bank of America | | 3.422 | Chord Energy Corp | Merrill Lynch | (4.187) |
| | | Merrill Lynch | (61.346) | (6.245) | Chord Energy Corp | Barclays Bank | 20.979 |
| 10.224 | Cheniere Energy Inc | Barclays Bank | (73.834) | 3.600 | Chord Energy Corp | Barclays Bank | (19.232) |
| 156 | Cheniere Energy Inc | Goldman Sachs | (2.016) | (1.810) | Chord Energy Corp | Goldman Sachs | (15.113) |
| 1.789 | Cheniere Energy Inc | HSBC | (22.738) | 1.658 | Chord Energy Corp | Goldman Sachs | 2.945 |
| 4.043 | Cheniere Energy Inc | Morgan Stanley | (28.333) | (4.658) | Chord Energy Corp | HSBC | (4.242) |
| (13.798) | Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT) | Barclays Bank | 1.104 | 399 | Chord Energy Corp | HSBC | 4.732 |
| (68.960) | Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 3.869 | (1.801) | ChromaDex Corp | Morgan Stanley | 26.177 |
| (7.939) | Chesapeake Energy Corp | Bank of America | | (2.671) | ChromaDex Corp | Morgan Stanley | (2.304) |
| | | Merrill Lynch | 49.142 | 3.366 | Chubb Ltd | Barclays Bank | 198 |
| 473 | Chesapeake Energy Corp | Bank of America | | 3.037 | Chubb Ltd | HSBC | (134) |
| | | Merrill Lynch | (2.928) | 710 | Chubb Ltd | Barclays Bank | (33.593) |
| (19.131) | Chesapeake Energy Corp | Barclays Bank | 114.786 | 623 | Chubb Ltd | Goldman Sachs | (35.928) |
| 11.101 | Chesapeake Energy Corp | Barclays Bank | (66.606) | 4.608 | Church & Dwight Co Inc | HSBC | (8.122) |
| (5.221) | Chesapeake Energy Corp | HSBC | 13.053 | 6.880 | Church & Dwight Co Inc | Morgan Stanley | (6.218) |
| (21.986) | Chesapeake Energy Corp | Morgan Stanley | 131.916 | (3.295) | Church & Dwight Co Inc | Bank of America | |
| (425) | Chesapeake Utilities Corp | Bank of America | | 3.682 | Church & Dwight Co Inc | Merrill Lynch | (15.055) |
| | | Merrill Lynch | 269 | 768 | Church & Dwight Co Inc | Barclays Bank | (22.429) |
| (1.985) | Chesapeake Utilities Corp | Barclays Bank | (1.587) | (2.837) | Churchill Downs Inc | Barclays Bank | 10.742 |
| (5.735) | Chesapeake Utilities Corp | Goldman Sachs | (1.606) | | | Goldman Sachs | (16.900) |
| (365) | Chesapeake Utilities Corp | HSBC | 410 | (8.886) | Churchill Downs Inc | HSBC | (2.509) |
| (1.620) | Chesapeake Utilities Corp | Morgan Stanley | 973 | (7.538) | Churchill Downs Inc | Bank of America | |
| 4.809 | Chevron Corp | Barclays Bank | (2.164) | (794) | Churchill Downs Inc | Merrill Lynch | (93.067) |
| 13.154 | Chevron Corp | Morgan Stanley | (5.919) | 6.040 | Ciena Corp | Barclays Bank | 59.892 |
| (2.780) | Chevron Corp | Morgan Stanley | 3.139 | 6.407 | Ciena Corp | Goldman Sachs | 82.616 |
| 754 | Chewy Inc 'A' | Bank of America | | 3.252 | Cigna Group | HSBC | 8.752 |
| | | Merrill Lynch | (1.094) | 9.259 | Cigna Group | Bank of America | |
| 631 | Chewy Inc 'A' | Goldman Sachs | (24) | 14.580 | Cigna Group | Merrill Lynch | (46.796) |
| 28.228 | Chewy Inc 'A' | HSBC | (92.588) | 6.195 | Cigna Group | Barclays Bank | (110.275) |
| 953 | Chewy Inc 'A' | Morgan Stanley | (31) | 501 | Cimpres Plc | Goldman Sachs | (209.806) |
| 63.587 | Chico's FAS Inc | Barclays Bank | (1.272) | 2.206 | Cimpres Plc | Morgan Stanley | (73.782) |
| 53.606 | Chico's FAS Inc | Goldman Sachs | (5.361) | | | Barclays Bank | (1.117) |
| (2.399) | Children's Place Inc | Bank of America | | | | Goldman Sachs | 419 |
| | | Merrill Lynch | 9.315 | | | | |
| (10.887) | Children's Place Inc | Barclays Bank | 85.136 | | | | |
| (2.428) | Children's Place Inc | HSBC | 26.732 | | | | |
| (8.733) | Chimera Investment Corp (REIT) | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 1.135 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 908 | Cimpress Plc | Morgan Stanley | (2.025) | (11.115) | Civitas Resources Inc | Bank of America | |
| 2.211 | Cincinnati Financial Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (5.891) |
| | | Merrill Lynch | (13.620) | (26.400) | Civitas Resources Inc | Barclays Bank | 92.917 |
| 2.083 | Cincinnati Financial Corp | Barclays Bank | (13.706) | 8.942 | Civitas Resources Inc | Barclays Bank | (31.923) |
| 470 | Cincinnati Financial Corp | Goldman Sachs | (2.895) | (182) | Civitas Resources Inc | Goldman Sachs | (96) |
| 1.804 | Cincinnati Financial Corp | HSBC | (14.703) | (2.105) | Civitas Resources Inc | HSBC | 476 |
| 2.854 | Cincinnati Financial Corp | Morgan Stanley | (18.779) | 5.605 | Civitas Resources Inc | HSBC | (2.186) |
| 11.509 | Cinemark Holdings Inc | Barclays Bank | (12.200) | (16.345) | Civitas Resources Inc | Morgan Stanley | 61.488 |
| 6.392 | Cinemark Holdings Inc | Goldman Sachs | (6.846) | 7.007 | Clarivate Plc | Bank of America | |
| 1.600 | Cinemark Holdings Inc | HSBC | (889) | | | Merrill Lynch | (3.749) |
| 3.991 | Cinemark Holdings Inc | Morgan Stanley | (4.230) | 13.735 | Clarivate Plc | Barclays Bank | 1.992 |
| 5.193 | Cintas Corp | Bank of America | | 40.553 | Clarivate Plc | HSBC | 5.475 |
| | | Merrill Lynch | 2.285 | 10.555 | Clarivate Plc | Morgan Stanley | 1.530 |
| 4.682 | Cintas Corp | Barclays Bank | (9.926) | (7.398) | Claros Mortgage Trust Inc | Bank of America | |
| 11.082 | Cintas Corp | Goldman Sachs | 4.876 | | | Merrill Lynch | 4.069 |
| 3.270 | Cintas Corp | HSBC | 30.020 | (9.070) | Claros Mortgage Trust Inc | HSBC | 7.800 |
| 2.977 | Cintas Corp | Morgan Stanley | (6.311) | (112.552) | Claros Mortgage Trust Inc | Morgan Stanley | (10.130) |
| 5.502 | CIRCOR International Inc | Bank of America | | (4.278) | Clarus Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (6.382) | (29.319) | Clarus Corp | Merrill Lynch | 2.481 |
| 4.700 | CIRCOR International Inc | Barclays Bank | (6.157) | (41.829) | Clarus Corp | Barclays Bank | 9.675 |
| 1.595 | CIRCOR International Inc | HSBC | 3.908 | (3.362) | Clarus Corp | Goldman Sachs | 24.261 |
| 3.710 | CIRCOR International Inc | Morgan Stanley | (4.860) | (2.026) | Clarus Corp | HSBC | (303) |
| 13.964 | Cirrus Logic Inc | Barclays Bank | 8.099 | (25.305) | Clean Energy Fuels Corp | Morgan Stanley | 669 |
| 1.267 | Cirrus Logic Inc | Goldman Sachs | (3.091) | | | Bank of America | |
| 2.845 | Cirrus Logic Inc | HSBC | (1.166) | (19.819) | Clean Energy Fuels Corp | Merrill Lynch | 16.701 |
| (54.397) | Cisco Systems Inc | Barclays Bank | (57.661) | (15.288) | Clean Energy Fuels Corp | Barclays Bank | 12.684 |
| (32.192) | Cisco Systems Inc | HSBC | (113.960) | (13.238) | Clean Energy Fuels Corp | HSBC | 5.351 |
| (2.127) | Citi Trends Inc | Bank of America | | (2.638) | Clean Harbors Inc | Morgan Stanley | 8.472 |
| | | Merrill Lynch | 3.063 | | | Bank of America | |
| (3.784) | Citi Trends Inc | Barclays Bank | 11.844 | (14.789) | Clean Harbors Inc | Merrill Lynch | (10.631) |
| (2.279) | Citi Trends Inc | Morgan Stanley | 7.133 | (4.211) | Clean Harbors Inc | Barclays Bank | 30.466 |
| 4.404 | Citigroup Inc | Bank of America | | (14.787) | Clean Harbors Inc | HSBC | (28.593) |
| | | Merrill Lynch | (10.875) | 27.644 | Cleanspark Inc | Morgan Stanley | 30.461 |
| 26.015 | Citigroup Inc | Barclays Bank | (38.393) | 4.661 | Cleanspark Inc | Barclays Bank | (3.041) |
| 11.320 | Citigroup Inc | Goldman Sachs | (18.610) | 41.173 | Clear Channel Outdoor Holdings Inc | Morgan Stanley | (732) |
| 9.501 | Citigroup Inc | HSBC | (21.947) | 10.459 | Clear Channel Outdoor Holdings Inc | Bank of America | |
| 37.631 | Citigroup Inc | Morgan Stanley | (65.614) | 9.836 | Clear Channel Outdoor Holdings Inc | Merrill Lynch | 5.147 |
| (113.720) | Citius Pharmaceuticals Inc | HSBC | 19.332 | 3.652 | Clear Secure Inc 'A' | Barclays Bank | (784) |
| (14.621) | Citizens & Northern Corp | Bank of America | | 6.042 | Clear Secure Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (22.663) | 3.495 | Clear Secure Inc 'A' | Merrill Lynch | (329) |
| (8.554) | Citizens & Northern Corp | Barclays Bank | 171 | 2.404 | Clear Secure Inc 'A' | Barclays Bank | (3.625) |
| (11.573) | Citizens & Northern Corp | HSBC | (19.327) | 6.102 | Clear Secure Inc 'A' | Goldman Sachs | (315) |
| (2.265) | Citizens & Northern Corp | Morgan Stanley | 45 | (3.001) | Clearfield Inc | HSBC | (2.091) |
| 16.707 | Citizens Financial Group Inc | Bank of America | | | | Morgan Stanley | (3.661) |
| 27.323 | Citizens Financial Group Inc | Merrill Lynch | 3.464 | (2.848) | Clearfield Inc | Bank of America | |
| 37.278 | Citizens Financial Group Inc | Barclays Bank | (19.126) | (685) | Clearfield Inc | Merrill Lynch | (3.331) |
| 29.616 | Citizens Financial Group Inc | Goldman Sachs | 3.278 | (5.630) | Clearfield Inc | Barclays Bank | (4.187) |
| 25.306 | Citizens Financial Group Inc | HSBC | 25.847 | (2.853) | Clearfield Inc | Goldman Sachs | (760) |
| (944) | Citizens Holding Co | Morgan Stanley | (13.969) | (15.257) | ClearPoint Neuro Inc | HSBC | (13.118) |
| | | Bank of America | | (8.347) | ClearPoint Neuro Inc | Morgan Stanley | (3.433) |
| | | Merrill Lynch | 99 | (2.815) | ClearPoint Neuro Inc | Barclays Bank | 7.781 |
| (8.513) | Citizens Holding Co | Goldman Sachs | 894 | (54.218) | Clearside Biomedical Inc | Goldman Sachs | 9.265 |
| 42.112 | Citizens Inc | Barclays Bank | (421) | (3.478) | Clearwater Paper Corp | HSBC | 4.926 |
| (6.939) | City Holding Co | Barclays Bank | 5.621 | | | Barclays Bank | 1.627 |
| (3.139) | City Holding Co | Goldman Sachs | (8.883) | (12.795) | Clearwater Paper Corp | Bank of America | |
| (313) | City Holding Co | HSBC | (448) | (4.457) | Clearwater Paper Corp | Merrill Lynch | 2.504 |
| (5.233) | Civeo Corp | Bank of America | | (890) | Clearwater Paper Corp | Barclays Bank | 16.423 |
| | | Merrill Lynch | 7.588 | 5.292 | Clearway Energy Inc 'A' | HSBC | 6.947 |
| (1.182) | Civeo Corp | Barclays Bank | 1.726 | | | Morgan Stanley | 1.202 |
| (5.576) | Civeo Corp | Goldman Sachs | 8.085 | 68.599 | Clearway Energy Inc 'A' | Bank of America | |
| 7.140 | Civista Bancshares Inc | Bank of America | | 39.750 | Clearway Energy Inc 'A' | Merrill Lynch | (15.135) |
| | | Merrill Lynch | 2.499 | 12.197 | Clearway Energy Inc 'A' | Barclays Bank | (93.295) |
| 14.420 | Civista Bancshares Inc | Barclays Bank | (6.777) | 7.765 | Clearway Energy Inc 'C' | HSBC | (55.650) |
| 7.434 | Civista Bancshares Inc | Goldman Sachs | 2.203 | | | Morgan Stanley | (16.588) |
| 2.624 | Civista Bancshares Inc | HSBC | 1.129 | 52.225 | Clearway Energy Inc 'C' | Bank of America | |
| 3.884 | Civista Bancshares Inc | Morgan Stanley | (1.825) | | | Merrill Lynch | (8.865) |
| | | | | | | Barclays Bank | (79.904) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.037 | Clearway Energy Inc 'C' | Goldman Sachs | (2.238) | 12.212 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Morgan Stanley | (35.659) |
| 26.905 | Clearway Energy Inc 'C' | HSBC | (43.572) | (8.573) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Morgan Stanley | 25.033 |
| 6.106 | Clearway Energy Inc 'C' | Morgan Stanley | (7.821) | (17.831) | Coda Octopus Group Inc | Barclays Bank | (28.530) |
| (16.791) | Cleveland-Cliffs Inc | Bank of America | | (9.400) | Coda Octopus Group Inc | Goldman Sachs | (16.826) |
| | | Merrill Lynch | 18.165 | (3.489) | Coda Octopus Group Inc | HSBC | (6.071) |
| (8.859) | Cleveland-Cliffs Inc | Barclays Bank | 9.213 | (2.093) | Coda Octopus Group Inc | Morgan Stanley | (3.349) |
| 6.318 | Cleveland-Cliffs Inc | HSBC | (8.024) | 21.040 | Codexis Inc | Bank of America | |
| 4.932 | Cleveland-Cliffs Inc | Morgan Stanley | (5.129) | | Codexis Inc | Merrill Lynch | (9.678) |
| 749 | Climb Global Solutions Inc | Bank of America | | 29.510 | Codexis Inc | Barclays Bank | (12.984) |
| | | Merrill Lynch | (1.171) | 10.020 | Codexis Inc | Goldman Sachs | (4.609) |
| 355 | Climb Global Solutions Inc | Morgan Stanley | (680) | 18.696 | Codexis Inc | HSBC | (20.753) |
| 59.046 | Clipper Realty Inc (REIT) | Barclays Bank | 6.495 | 7.505 | Codexis Inc | Morgan Stanley | (3.302) |
| 22.342 | Clipper Realty Inc (REIT) | Goldman Sachs | 7.820 | (56.966) | Co-Diagnostics Inc | Barclays Bank | 13.102 |
| 432 | Clorox Co | Barclays Bank | (508) | 5.008 | Codorus Valley Bancorp Inc | Bank of America | |
| (6.200) | Clorox Co | HSBC | 62.248 | | Codorus Valley Bancorp Inc | Merrill Lynch | 4.692 |
| 338 | Clorox Co | Morgan Stanley | (643) | 2.648 | Codorus Valley Bancorp Inc | Barclays Bank | 569 |
| (5.822) | Cloudflare Inc 'A' | Bank of America | | 8.274 | Codorus Valley Bancorp Inc | Goldman Sachs | 7.072 |
| | | Merrill Lynch | (91.370) | 1.230 | Codorus Valley Bancorp Inc | HSBC | 1.443 |
| (2.311) | Cloudflare Inc 'A' | Barclays Bank | (24.751) | 7.451 | Codorus Valley Bancorp Inc | Morgan Stanley | 1.602 |
| (2.550) | CME Group Inc | Bank of America | | 33.753 | Coeur Mining Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 16.702 | | Coeur Mining Inc | Merrill Lynch | (7.292) |
| (4.333) | CME Group Inc | Barclays Bank | 17.808 | 128.244 | Coeur Mining Inc | Barclays Bank | (38.473) |
| (2.727) | CME Group Inc | HSBC | 21.462 | 38.511 | Coeur Mining Inc | HSBC | (21.566) |
| (1.210) | CME Group Inc | Morgan Stanley | 4.973 | 19.669 | Coeur Mining Inc | Morgan Stanley | (6.302) |
| 76.378 | CMS Energy Corp | Barclays Bank | (127.551) | (16.835) | Cogent Biosciences Inc | Bank of America | |
| 54.648 | CMS Energy Corp | Goldman Sachs | (191.815) | | Cogent Biosciences Inc | Merrill Lynch | 3.704 |
| 1.321 | CNA Financial Corp | Bank of America | | (1.667) | Cogent Biosciences Inc | HSBC | 267 |
| | | Merrill Lynch | (3.976) | (1.423) | Cogent Biosciences Inc | Morgan Stanley | (783) |
| 61.466 | CNA Financial Corp | Barclays Bank | (132.152) | (6.875) | Cogent Communications Holdings Inc | Bank of America | |
| 34.380 | CNA Financial Corp | Goldman Sachs | (103.483) | | Cogent Communications Holdings Inc | Merrill Lynch | (4.477) |
| 28.165 | CNA Financial Corp | HSBC | (95.198) | (7.374) | Cogent Communications Holdings Inc | Barclays Bank | (7.300) |
| 7.282 | CNB Financial Corp | Bank of America | | (11.790) | Cogent Communications Holdings Inc | HSBC | (3.582) |
| | | Merrill Lynch | (728) | | Cognex Corp | Barclays Bank | 868 |
| 2.032 | CNB Financial Corp | Barclays Bank | (1.951) | (29.862) | Cognex Corp | Goldman Sachs | (108.399) |
| 9.138 | CNB Financial Corp | Goldman Sachs | (914) | (13.306) | Cognex Corp | HSBC | (62.094) |
| 12.626 | CNB Financial Corp | HSBC | (5.808) | (5.324) | Cognex Corp | Morgan Stanley | (11.020) |
| 22.296 | CNB Financial Corp | Morgan Stanley | (21.404) | (1.639) | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Barclays Bank | 2.336 |
| 33.320 | CNO Financial Group Inc | Barclays Bank | (9.663) | 1.058 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | HSBC | 1.000 |
| (11.905) | CNX Resources Corp | Bank of America | | (10.280) | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | HSBC | (9.715) |
| | | Merrill Lynch | 5.886 | (1.026) | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Morgan Stanley | 1.462 |
| (15.049) | CNX Resources Corp | Barclays Bank | 8.654 | 3.979 | Cohen & Steers Inc | Bank of America | |
| (39.347) | CNX Resources Corp | Goldman Sachs | 19.083 | | Cohen & Steers Inc | Merrill Lynch | (2.970) |
| (55.969) | CNX Resources Corp | HSBC | (10.699) | 4.922 | Cohen & Steers Inc | Barclays Bank | (14.914) |
| (56.828) | CNX Resources Corp | Morgan Stanley | 32.676 | 8.345 | Cohen & Steers Inc | Goldman Sachs | (5.257) |
| 742 | Coastal Financial Corp | Barclays Bank | (972) | 4.602 | Cohen & Steers Inc | HSBC | (1.795) |
| 913 | Coastal Financial Corp | Goldman Sachs | 730 | 5.204 | Cohen & Steers Inc | Morgan Stanley | (15.768) |
| 3.112 | Coastal Financial Corp | HSBC | 1.774 | 3.182 | Coherent Corp | HSBC | 26.789 |
| 435 | Coastal Financial Corp | Morgan Stanley | (570) | 759 | Coherent Corp | Morgan Stanley | 4.531 |
| 25.252 | Coca-Cola Co | Barclays Bank | (52.524) | 21.992 | Coherus Biosciences Inc | Barclays Bank | (9.457) |
| 38.706 | Coca-Cola Co | HSBC | (173.790) | 7.032 | Coherus Biosciences Inc | Goldman Sachs | (6.048) |
| (495) | Coca-Cola Consolidated Inc | Bank of America | | 35.511 | Coherus Biosciences Inc | HSBC | (145.950) |
| | | Merrill Lynch | (18.013) | 4.666 | Coherus Biosciences Inc | Morgan Stanley | (2.006) |
| (514) | Coca-Cola Consolidated Inc | Barclays Bank | (3.012) | (7.036) | Cohu Inc | Barclays Bank | (7.036) |
| 351 | Coca-Cola Consolidated Inc | Barclays Bank | 2.057 | (14.240) | Cohu Inc | Goldman Sachs | (48.986) |
| 38 | Coca-Cola Consolidated Inc | HSBC | 519 | (9.975) | Cohu Inc | Morgan Stanley | (9.975) |
| (580) | Coca-Cola Consolidated Inc | Morgan Stanley | (3.399) | 525 | Coinbase Global Inc 'A' | Bank of America | |
| (2.321) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Bank of America | | | Coinbase Global Inc 'A' | Merrill Lynch | 536 |
| (8.077) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Merrill Lynch | 9.607 | (621) | Coinbase Global Inc 'A' | Barclays Bank | (386) |
| | | Barclays Bank | 23.585 | 643 | Coinbase Global Inc 'A' | Goldman Sachs | 656 |
| 14.652 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Goldman Sachs | (63.150) | (7.224) | Colgate-Palmolive Co | Bank of America | |
| (1.676) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Goldman Sachs | 6.617 | | Colgate-Palmolive Co | Merrill Lynch | 47.534 |
| 23.321 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | HSBC | (81.157) | (6.098) | Colgate-Palmolive Co | Barclays Bank | 22.305 |
| (6.936) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | HSBC | 24.137 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|---|-----------------|---|----------|---|-----------------|---|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| (21.319) | Colgate-Palmolive Co | HSBC | 134.139 | 7.225 | CommScope Holding Co Inc | Goldman Sachs | (2.023) |
| (11.793) | Colgate-Palmolive Co | Morgan Stanley | 46.111 | (10.285) | Community Bank System Inc | Barclays Bank | (1.646) |
| 12.747 | Collegium Pharmaceutical Inc | Barclays Bank | (22.052) | (17.445) | Community Bank System Inc | Goldman Sachs | (57.220) |
| 4.515 | Collegium Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (7.766) | (23.615) | Community Bank System Inc | HSBC | (54.551) |
| 4.625 | Collegium Pharmaceutical Inc | HSBC | (5.449) | 198 | Community Financial Corp | Bank of America | |
| 3.802 | Collegium Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | (2.616) | | | Merrill Lynch | 236 |
| 11.050 | Colony Bankcorp Inc | Bank of America | 2.652 | 3.660 | Community Financial Corp | Barclays Bank | 1.720 |
| 31.458 | Colony Bankcorp Inc | Merrill Lynch | (2.202) | 423 | Community Financial Corp | Goldman Sachs | 503 |
| 21.657 | Colony Bankcorp Inc | Barclays Bank | 5.198 | 3.210 | Community Financial Corp | Morgan Stanley | 1.509 |
| 15.556 | Colony Bankcorp Inc | Goldman Sachs | 5.289 | 10.048 | Community Health Systems Inc | Barclays Bank | (3.014) |
| 17.477 | Colony Bankcorp Inc | HSBC | (1.223) | (7.899) | Community Healthcare Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| 275 | Columbia Banking System Inc | Morgan Stanley | (28) | (18.105) | Community Healthcare Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | 20.982 |
| 5.320 | Columbia Banking System Inc | Bank of America | (28) | (28.107) | Community Healthcare Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 13.398 |
| 31.649 | Columbia Banking System Inc | Merrill Lynch | (6.224) | (27.864) | Community Healthcare Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 75.889 |
| (56.281) | Columbia Financial Inc | Barclays Bank | (6.754) | (4.678) | Community Healthcare Trust Inc (REIT) | HSBC | 103.933 |
| (85.002) | Columbia Financial Inc | Goldman Sachs | (35.701) | 23.917 | Community Trust Bancorp Inc | Morgan Stanley | 3.462 |
| (31.421) | Columbia Financial Inc | Barclays Bank | (11.312) | 5.391 | Community Trust Bancorp Inc | Barclays Bank | (27.026) |
| 3.374 | Columbia Sportswear Co | HSBC | (13.226) | 292 | CommVault Systems Inc | HSBC | 593 |
| (29.959) | Columbia Sportswear Co | Bank of America | 87.480 | 14.018 | CommVault Systems Inc | Bank of America | 731 |
| 522 | Columbia Sportswear Co | Merrill Lynch | (1.524) | 4.356 | CommVault Systems Inc | Barclays Bank | 35.185 |
| (1.977) | Columbia Sportswear Co | Barclays Bank | 16.567 | (42.438) | Compass Diversified Holdings | HSBC | 18.592 |
| 3.551 | Columbia Sportswear Co | HSBC | (29.757) | (4.391) | Compass Diversified Holdings | Barclays Bank | 7.094 |
| 1.323 | Columbia Sportswear Co | HSBC | (3.863) | (5.130) | Compass Diversified Holdings | HSBC | (4.654) |
| 4.132 | Columbus McKinnon Corp | Morgan Stanley | 1.488 | (5.130) | Compass Diversified Holdings | Morgan Stanley | 975 |
| 5.307 | Columbus McKinnon Corp | Barclays Bank | 11.835 | 8.597 | Compass Inc 'A' | Barclays Bank | (5.760) |
| 6.695 | Columbus McKinnon Corp | Goldman Sachs | 16.604 | 10.115 | Compass Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.777) |
| 6.721 | Columbus McKinnon Corp | HSBC | 2.420 | (2.051) | Compass Minerals International Inc | Bank of America | |
| 1.431 | Comcast Corp 'A' | Morgan Stanley | (2.891) | (7.398) | Compass Minerals International Inc | Merrill Lynch | 3.159 |
| (11.374) | Comcast Corp 'A' | Barclays Bank | 22.975 | (4.480) | Compass Minerals International Inc | Barclays Bank | 19.605 |
| 5.533 | Comcast Corp 'A' | Goldman Sachs | (5.422) | (11.504) | Compass Therapeutics Inc | HSBC | (3.360) |
| (120) | Comcast Corp 'A' | HSBC | (11.793) | (2.638) | CompoSecure Inc | Goldman Sachs | 6.212 |
| 8.608 | Comcast Corp 'A' | HSBC | (99) | (2.648) | CompoSecure Inc | Barclays Bank | 528 |
| 2.579 | Comcast Corp 'A' | Morgan Stanley | (99) | (11.894) | CompoSecure Inc | Morgan Stanley | 530 |
| (994) | Comcast Corp 'A' | Morgan Stanley | 2.008 | (11.894) | Computer Programs and Systems Inc | Barclays Bank | 8.088 |
| 6.600 | Comerica Inc | Barclays Bank | (20.658) | (15.024) | Computer Programs and Systems Inc | Goldman Sachs | (7.362) |
| (5.967) | Comerica Inc | HSBC | (24.947) | 862 | CompX International Inc | Bank of America | |
| (903) | Comerica Inc | Morgan Stanley | 2.826 | 5.581 | CompX International Inc | Merrill Lynch | (1.237) |
| 1.329 | Comfort Systems USA Inc | Bank of America | (1.741) | 2.748 | CompX International Inc | Barclays Bank | 921 |
| 6.882 | Comfort Systems USA Inc | Merrill Lynch | (5.745) | 4.049 | CompX International Inc | Goldman Sachs | (3.943) |
| 4.335 | Comfort Systems USA Inc | Barclays Bank | (5.850) | 80.216 | comScore Inc | Morgan Stanley | 668 |
| 2.322 | Comfort Systems USA Inc | Goldman Sachs | (5.679) | (45.067) | Comstock Resources Inc | Barclays Bank | (8.022) |
| (18.456) | Commerce Bancshares Inc | HSBC | 5.155 | (49.188) | Comstock Resources Inc | Bank of America | |
| (61.284) | Commerce Bancshares Inc | Barclays Bank | 19.010 | (49.862) | Comstock Resources Inc | Merrill Lynch | 33.801 |
| (22.488) | Commerce Bancshares Inc | Goldman Sachs | 102.344 | (11.144) | Comstock Resources Inc | Barclays Bank | 53.124 |
| (6.825) | Commerce Bancshares Inc | HSBC | 63.866 | (22.521) | Comstock Resources Inc | Goldman Sachs | 37.396 |
| 2.956 | Commerce Bancshares Inc | HSBC | (34.370) | 9.753 | Comtech Telecommunications Corp | HSBC | 3.789 |
| 61.863 | Commercial Metals Co | Morgan Stanley | 7.030 | | | Morgan Stanley | 24.323 |
| 19.457 | Commercial Metals Co | Bank of America | (5.745) | | | | |
| 24.403 | Commercial Metals Co | Merrill Lynch | (148.092) | | | | |
| 5.929 | Commercial Metals Co | Barclays Bank | (12.676) | | | | |
| (2.641) | Commercial Vehicle Group Inc | Barclays Bank | 1.954 | | | | |
| (6.882) | Commercial Vehicle Group Inc | Goldman Sachs | 2.065 | | | | |
| (10.141) | Commercial Vehicle Group Inc | HSBC | 2.535 | | | | |
| (14.098) | CommScope Holding Co Inc | Bank of America | 3.947 | | | | |
| (44.178) | CommScope Holding Co Inc | Merrill Lynch | 5.301 | | | | |
| | | Barclays Bank | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.480 | Conagra Brands Inc | Goldman Sachs | (2.990) | (13.316) | Constellation Energy Corp | HSBC | (50.237) |
| 2.286 | Concentrix Corp | Bank of America | | (15.524) | Constellation Energy Corp | Morgan Stanley | 1.447 |
| | | Merrill Lynch | (9.167) | 19.190 | Constellium SE | Barclays Bank | (13.049) |
| (1.996) | Concentrix Corp | Barclays Bank | 16.367 | 1.209 | Constellium SE | Goldman Sachs | (435) |
| 2.949 | Concentrix Corp | Barclays Bank | (24.182) | (679) | Construction Partners Inc 'A' | Bank of America | |
| 2.293 | Concentrix Corp | Morgan Stanley | (18.803) | | | Merrill Lynch | (244) |
| (2.222) | Concert Pharmaceuticals Inc' | Bank of America | | (24.516) | Construction Partners Inc 'A' | Barclays Bank | 24.761 |
| | | Merrill Lynch | 1.400 | (20.513) | Consumer Portfolio Services Inc | Goldman Sachs | (34.257) |
| (15.723) | Concert Pharmaceuticals Inc' | Barclays Bank | (5.818) | (24.689) | Consumer Portfolio Services Inc | Morgan Stanley | (11.851) |
| (2.530) | Concert Pharmaceuticals Inc' | Goldman Sachs | — | 40.777 | Container Store Group Inc | Bank of America | |
| (11.176) | Concert Pharmaceuticals Inc' | HSBC | (4.135) | 61.383 | Container Store Group Inc | Merrill Lynch | (15.903) |
| 964 | Concrete Pumping Holdings Inc | Bank of America | | 47.994 | Container Store Group Inc | Barclays Bank | 14.118 |
| | | Merrill Lynch | 125 | 14.848 | Container Store Group Inc | Goldman Sachs | (18.718) |
| 27.430 | Concrete Pumping Holdings Inc | Barclays Bank | (4.663) | 16.581 | Container Store Group Inc | HSBC | (8.166) |
| 19.293 | Concrete Pumping Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.508 | (31.319) | Container Store Group Inc | Morgan Stanley | 3.814 |
| 23.156 | Concrete Pumping Holdings Inc | HSBC | 2.316 | | ContextLogic Inc 'A' | Bank of America | |
| 18.829 | Concrete Pumping Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.201) | (7.155) | ContextLogic Inc 'A' | Merrill Lynch | 18.165 |
| 18.380 | Conduent Inc | Barclays Bank | (8.914) | (6.308) | Cooper Cos Inc | Morgan Stanley | 5.223 |
| 20.229 | Conduent Inc | Goldman Sachs | 2.529 | (1.967) | Cooper Cos Inc | Barclays Bank | 142.308 |
| (2.820) | Confluent Inc 'A' | Barclays Bank | (8.037) | (1.094) | Cooper Cos Inc | Goldman Sachs | 42.822 |
| (1.794) | Confluent Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.113) | 2.021 | Cooper-Standard Holdings Inc | HSBC | 20.272 |
| (8.397) | CONMED Corp | Barclays Bank | 21.832 | | Cooper-Standard Holdings Inc | Bank of America | |
| (2.156) | CONMED Corp | Goldman Sachs | 7.546 | 1.742 | Cooper-Standard Holdings Inc | Merrill Lynch | 303 |
| 1.360 | ConnectOne Bancorp Inc | Bank of America | | 11.428 | Cooper-Standard Holdings Inc | Barclays Bank | (2.073) |
| | | Merrill Lynch | (231) | | Copa Holdings SA 'A' | Goldman Sachs | 1.714 |
| 42.064 | ConnectOne Bancorp Inc | Barclays Bank | (32.389) | 711 | Copa Holdings SA 'A' | Bank of America | |
| 33.268 | ConnectOne Bancorp Inc | Goldman Sachs | (5.656) | 3.296 | Copa Holdings SA 'A' | Merrill Lynch | 128 |
| 13.788 | ConnectOne Bancorp Inc | HSBC | (9.100) | 2.681 | Copa Holdings SA 'A' | Barclays Bank | 6.723 |
| 1.097 | ConnectOne Bancorp Inc | Morgan Stanley | (845) | 4.656 | Copa Holdings SA 'A' | Goldman Sachs | 483 |
| 8.863 | Conn's Inc | Bank of America | | 1.027 | Copa Holdings SA 'A' | HSBC | 55.221 |
| | | Merrill Lynch | (266) | 1.027 | Copa Holdings SA 'A' | Morgan Stanley | 2.095 |
| 10.715 | Conn's Inc | Barclays Bank | 321 | (5.674) | Copart Inc | Barclays Bank | 6.695 |
| 26.427 | Conn's Inc | Goldman Sachs | (793) | (34.219) | Copart Inc | Goldman Sachs | (217.633) |
| 3.809 | Conn's Inc | HSBC | (1.676) | (2.603) | Copart Inc | HSBC | (22.282) |
| 11.759 | Conn's Inc | Morgan Stanley | 353 | 20.873 | Corcept Therapeutics Inc | Barclays Bank | (28.179) |
| 3.175 | ConocoPhillips | Bank of America | | 1.865 | Corcept Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.436) |
| | | Merrill Lynch | 127 | 10.765 | Corcept Therapeutics Inc | HSBC | (5.060) |
| 10.880 | ConocoPhillips | Barclays Bank | (36.992) | (10.945) | Core & Main Inc 'A' | Barclays Bank | 3.611 |
| 12.229 | ConocoPhillips | Goldman Sachs | 489 | (4.032) | Core & Main Inc 'A' | Goldman Sachs | 847 |
| 29.500 | ConocoPhillips | HSBC | (16.815) | (7.584) | Core & Main Inc 'A' | HSBC | (379) |
| 32.728 | ConocoPhillips | Morgan Stanley | (111.276) | (6.320) | Core & Main Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.086 |
| (5.749) | Consensus Cloud Solutions Inc | Goldman Sachs | (5.232) | (4.915) | Corebridge Financial Inc | Bank of America | |
| (14.253) | Consolidated Communications Holdings Inc | Barclays Bank | 998 | | Corebridge Financial Inc | Merrill Lynch | (1.600) |
| (36.069) | Consolidated Communications Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.082 | (116.084) | Corebridge Financial Inc | Barclays Bank | 37.147 |
| (2.721) | Consolidated Edison Inc | Bank of America | | (5.280) | Corebridge Financial Inc | Goldman Sachs | 1.660 |
| | | Merrill Lynch | 10.868 | (45.394) | Corebridge Financial Inc | HSBC | (9.015) |
| (2.600) | Consolidated Edison Inc | Barclays Bank | 5.304 | (48.168) | Corebridge Financial Inc | Morgan Stanley | 15.414 |
| (2.537) | Consolidated Edison Inc | Goldman Sachs | 8.240 | (2.149) | CoreCard Corp | Bank of America | |
| 3.446 | Consolidated Edison Inc | HSBC | (22.054) | (11.384) | CoreCard Corp | Merrill Lynch | 408 |
| (9.386) | Consolidated Edison Inc | HSBC | 58.839 | (2.195) | CoreCard Corp | Barclays Bank | 23.679 |
| 11.373 | Consolidated Edison Inc | Morgan Stanley | (23.201) | 10.072 | CoreCivic Inc | Morgan Stanley | 4.566 |
| (16.554) | Consolidated Edison Inc | Morgan Stanley | 33.770 | | CoreCivic Inc | Bank of America | |
| (2.361) | Constellation Brands Inc 'A' | Barclays Bank | (5.761) | | CoreCivic Inc | Merrill Lynch | (5.439) |
| (13.448) | Constellation Brands Inc 'A' | Goldman Sachs | (101.802) | (30.061) | CorMedix Inc | Barclays Bank | 9.920 |
| (12.407) | Constellation Brands Inc 'A' | HSBC | (120.348) | (8.405) | CorMedix Inc | HSBC | 3.782 |
| (592) | Constellation Brands Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.444) | (37.471) | Corning Inc | Barclays Bank | 31.476 |
| (11.602) | Constellation Energy Corp | Bank of America | | (20.137) | Corning Inc | Goldman Sachs | 10.874 |
| | | Merrill Lynch | (26.659) | (10.140) | Corning Inc | HSBC | 8.213 |
| (5.855) | Constellation Energy Corp | Barclays Bank | 117 | (21.907) | Corning Inc | Morgan Stanley | 18.402 |
| (12.264) | Constellation Energy Corp | Goldman Sachs | (39.735) | 11.456 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (7.808) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 74.539 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Barclays Bank | (13.609) | 2.178 | Covenant Logistics Group Inc | HSBC | (2.592) |
| 8.964 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Goldman Sachs | (6.113) | 1.126 | CPI Card Group Inc | Barclays Bank | (1.317) |
| 18.523 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | HSBC | (26.282) | 579 | CPI Card Group Inc | Goldman Sachs | (660) |
| 14.873 | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Morgan Stanley | (3.123) | (10.772) | CPS Technologies Corp | Barclays Bank | 2.262 |
| (9.044) | Corsair Gaming Inc | Bank of America | | (1.891) | CPS Technologies Corp | Goldman Sachs | (38) |
| (10.915) | Corsair Gaming Inc | Merrill Lynch | (8.320) | (683) | CRA International Inc | Bank of America | |
| (2.051) | Corsair Gaming Inc | Barclays Bank | 2.292 | (3.974) | CRA International Inc | Merrill Lynch | 3.128 |
| (13.770) | Corsair Gaming Inc | HSBC | (4.547) | (1.022) | CRA International Inc | Barclays Bank | 16.413 |
| (13.177) | Corveva Inc | Morgan Stanley | 2.892 | (1.894) | CRA International Inc | HSBC | 1.001 |
| (3.305) | Corveva Inc | Barclays Bank | 39.926 | (3.821) | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Morgan Stanley | 7.822 |
| (12.781) | Corveva Inc | HSBC | 12.427 | (921) | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Bank of America | 30.835 |
| (113) | CorVel Corp | Morgan Stanley | 38.726 | (2.609) | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Barclays Bank | 7.414 |
| (534) | CorVel Corp | Bank of America | | (2.062) | Crane Co | HSBC | 7.018 |
| (1.327) | CorVel Corp | Merrill Lynch | 3.088 | (7.292) | Crane Co | Bank of America | |
| (416) | CorVel Corp | Barclays Bank | 5.516 | (7.775) | Crane Co | Merrill Lynch | 5.810 |
| 807 | Corvus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 36.267 | (3.353) | Crane Co | Barclays Bank | 6.459 |
| (44.019) | Costamare Inc | Morgan Stanley | 4.297 | (10.676) | Crane Co | Goldman Sachs | 23.636 |
| (42.021) | Costamare Inc | Goldman Sachs | 29.835 | (5.407) | Crane NXT Co | HSBC | 4.218 |
| (10.772) | Costamare Inc | HSBC | 7.110 | (7.775) | Crane NXT Co | Morgan Stanley | 8.869 |
| (4.062) | CoStar Group Inc | Barclays Bank | 2.884 | (3.413) | Crane NXT Co | Barclays Bank | 2.487 |
| (2.714) | CoStar Group Inc | Goldman Sachs | (8.576) | 88.030 | Crawford & Co 'A' | Goldman Sachs | (17.572) |
| (11.876) | CoStar Group Inc | Morgan Stanley | 8.432 | 3.449 | Crawford & Co 'A' | Morgan Stanley | 1.570 |
| (1.792) | Costco Wholesale Corp | Bank of America | | 280 | Credicorp Ltd | Barclays Bank | 14.085 |
| (1.725) | Costco Wholesale Corp | Merrill Lynch | (1.614) | 537 | Credicorp Ltd | HSBC | 483 |
| (2.214) | Costco Wholesale Corp | Barclays Bank | (1.776) | 951 | Credicorp Ltd | Bank of America | (1.106) |
| (604) | Costco Wholesale Corp | Goldman Sachs | (8.723) | 2.156 | Credicorp Ltd | Goldman Sachs | (4.489) |
| (5.386) | Costco Wholesale Corp | HSBC | (11.740) | (737) | Credit Acceptance Corp | HSBC | (13.520) |
| (6.300) | Coterra Energy Inc | Morgan Stanley | (41.833) | (543) | Credit Acceptance Corp | Morgan Stanley | (8.516) |
| (46.373) | Coterra Energy Inc | Bank of America | | (41.547) | Credo Technology Group Holding Ltd | Merrill Lynch | (12.057) |
| (74.019) | Coterra Energy Inc | Merrill Lynch | 13.545 | | Credo Technology Group Holding Ltd | Morgan Stanley | (5.631) |
| (58.924) | Coterra Energy Inc | Barclays Bank | 115.005 | (28.932) | Credo Technology Group Holding Ltd | Goldman Sachs | (211.059) |
| (21.956) | Coterra Energy Inc | Goldman Sachs | 152.075 | 7.296 | Crescent Energy Co 'A' | Morgan Stanley | (84.481) |
| (148.404) | Coty Inc 'A' | HSBC | 82.618 | 8.988 | Crescent Energy Co 'A' | Bank of America | |
| (27.085) | Coty Inc 'A' | Morgan Stanley | 54.451 | 17.091 | Crescent Energy Co 'A' | Merrill Lynch | (4.378) |
| (32.441) | Coty Inc 'A' | Barclays Bank | 60.103 | 12.656 | Crescent Energy Co 'A' | Barclays Bank | (6.561) |
| (33.081) | Coty Inc 'A' | Goldman Sachs | 16.928 | 15.118 | Crescent Energy Co 'A' | Goldman Sachs | (10.255) |
| 5.763 | Couchbase Inc | HSBC | 43.201 | 1.225 | Crinetics Pharmaceuticals Inc | HSBC | (17.339) |
| 11.202 | Coupang Inc | Morgan Stanley | 12.163 | 12.945 | Crinetics Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (11.036) |
| 1.507 | Coupang Inc | Goldman Sachs | 22.591 | 3.859 | Crinetics Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 8.783 | Coupang Inc | Bank of America | | 8.820 | Crinetics Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (7) |
| 31.848 | Coupang Inc | Merrill Lynch | (12.210) | 5.159 | Crocs Inc | Barclays Bank | (9.709) |
| 7.021 | Coupang Inc | Barclays Bank | (844) | 2.039 | Crocs Inc | Goldman Sachs | (577) |
| (1.787) | Coursera Inc | Goldman Sachs | (9.573) | 4.397 | Crocs Inc | HSBC | (4.047) |
| (11.741) | Coursera Inc | HSBC | (74.206) | 6.677 | Crocs Inc | Bank of America | |
| (32.772) | Coursera Inc | Morgan Stanley | (3.932) | 4.291 | Crocs Inc | Merrill Lynch | (27.510) |
| (7.847) | Coursera Inc | Merrill Lynch | 44 | 3.735 | Cross Country Healthcare Inc | Barclays Bank | 10.088 |
| (20.834) | Cousins Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (1.292) | 3.748 | Cross Country Healthcare Inc | Goldman Sachs | (18.834) |
| (22.615) | Cousins Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (13.109) | 3.212 | CrossFirst Bankshares Inc | HSBC | (31.359) |
| (8.926) | Cousins Properties Inc (REIT) | HSBC | (9.103) | 10.992 | CrossFirst Bankshares Inc | Morgan Stanley | 18.645 |
| (13.674) | Cousins Properties Inc (REIT) | Bank of America | | 12.202 | CrossFirst Bankshares Inc | Bank of America | |
| (9.521) | Cousins Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | (3.958) | (1.572) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | 610 |
| (9.521) | Cousins Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 9.498 | (644) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (4.287) |
| (8.926) | Cousins Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.722) | (904) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.318 |
| (13.674) | Cousins Properties Inc (REIT) | HSBC | 7.068 | | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | HSBC | (20.279) |
| (9.521) | Cousins Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 3.999 | | | | (10.930) |
| 1.998 | Covenant Logistics Group Inc | Merrill Lynch | (639) | | | | (13.218) |
| 17.532 | Covenant Logistics Group Inc | Barclays Bank | (26.649) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.966 | Crown Castle Inc (REIT) | Barclays Bank | (6.409) | 2.712 | Curo Group Holdings Corp | Bank of America | |
| 5.008 | Crown Castle Inc (REIT) | Goldman Sachs | (10.517) | | | Merrill Lynch | (678) |
| 2.868 | Crown Castle Inc (REIT) | HSBC | (13.107) | 4.339 | Curo Group Holdings Corp | Barclays Bank | 347 |
| (2.644) | Crown Holdings Inc | Goldman Sachs | 16.287 | 3.789 | Curo Group Holdings Corp | HSBC | (1.743) |
| (1.246) | Crown Holdings Inc | HSBC | 9.129 | 3.670 | Curo Group Holdings Corp | Morgan Stanley | 294 |
| (2.711) | Crown Holdings Inc | Morgan Stanley | 10.410 | 5.999 | Curtiss-Wright Corp | Bank of America | |
| (4.607) | CS Disco Inc | Goldman Sachs | (10.366) | | | Merrill Lynch | (40.494) |
| 8.203 | CSG Systems International Inc | Bank of America | | 10.009 | Curtiss-Wright Corp | Barclays Bank | (67.661) |
| | | Merrill Lynch | (16.460) | 27.354 | Curtiss-Wright Corp | Goldman Sachs | (184.640) |
| 23.029 | CSG Systems International Inc | Barclays Bank | (48.368) | 2.246 | Curtiss-Wright Corp | HSBC | (9.838) |
| 2.287 | CSG Systems International Inc | Goldman Sachs | (3.208) | 3.042 | Curtiss-Wright Corp | Morgan Stanley | (20.564) |
| 4.260 | CSG Systems International Inc | HSBC | (6.007) | (62.177) | Cushman & Wakefield Plc | Barclays Bank | 15.544 |
| 3.500 | CSG Systems International Inc | Morgan Stanley | (6.653) | (42.081) | Cushman & Wakefield Plc | Goldman Sachs | (8.837) |
| (5.249) | CSW Industrials Inc | Barclays Bank | (25.090) | (17.946) | Cushman & Wakefield Plc | HSBC | (6.461) |
| (1.221) | CSW Industrials Inc | Goldman Sachs | (11.355) | (56.651) | Cushman & Wakefield Plc | Morgan Stanley | 14.163 |
| (31.948) | CSX Corp | Bank of America | | 7.848 | Custom Truck One Source Inc | | |
| | | Merrill Lynch | 40.574 | (1.177) | Customers Bancorp Inc | Morgan Stanley | (2.668) |
| (5.621) | CSX Corp | Goldman Sachs | 7.139 | (4.075) | Customers Bancorp Inc | Bank of America | |
| (21.352) | CSX Corp | HSBC | 20.617 | (11.129) | Customers Bancorp Inc | Merrill Lynch | (6.073) |
| (43.474) | CSX Corp | Morgan Stanley | 50.430 | (3.831) | Cutera Inc | HSBC | (25.510) |
| 19.560 | CTO Realty Growth Inc (REIT) | Bank of America | | | | Morgan Stanley | 2.003 |
| | | Merrill Lynch | (6.650) | (3.831) | Cutera Inc | Bank of America | |
| 9.636 | CTO Realty Growth Inc (REIT) | Barclays Bank | (3.565) | (6.330) | Cutera Inc | Merrill Lynch | (1.303) |
| 28.188 | CTO Realty Growth Inc (REIT) | Goldman Sachs | (9.584) | (5.865) | Cutera Inc | Barclays Bank | 5.191 |
| 20.496 | CTO Realty Growth Inc (REIT) | HSBC | (7.174) | (1.610) | Cutera Inc | Goldman Sachs | (1.994) |
| 28.242 | CTO Realty Growth Inc (REIT) | Morgan Stanley | (10.450) | (3.735) | Cutera Inc | HSBC | 53 |
| (906) | CTS Corp | Bank of America | | (26.964) | CVB Financial Corp | Morgan Stanley | 3.063 |
| | | Merrill Lynch | (1.243) | (5.109) | CVB Financial Corp | Barclays Bank | (3.506) |
| (16.568) | CTS Corp | Barclays Bank | (6.959) | (6.838) | Cvent Holding Corp | HSBC | (2.197) |
| (3.826) | CTS Corp | Goldman Sachs | (10.254) | (4.038) | Cvent Holding Corp | Goldman Sachs | (205) |
| (7.520) | CTS Corp | HSBC | (27.147) | (33.277) | Cvent Holding Corp | HSBC | (162) |
| 8.782 | CubeSmart (REIT) | Goldman Sachs | (8.958) | 2.760 | CVR Energy Inc | Morgan Stanley | (998) |
| 1.319 | CubeSmart (REIT) | Morgan Stanley | (132) | | | Bank of America | |
| 6.029 | Cue Biopharma Inc | Barclays Bank | 1.025 | 5.349 | CVR Energy Inc | Merrill Lynch | (4.416) |
| 13.266 | Cue Biopharma Inc | Goldman Sachs | (5.572) | 8.629 | CVR Energy Inc | Barclays Bank | (11.714) |
| 2.746 | Cue Biopharma Inc | HSBC | (2.416) | 11.396 | CVR Energy Inc | HSBC | (12.857) |
| 9.079 | Cue Biopharma Inc | Morgan Stanley | 1.543 | (8.034) | CVR Energy Inc | Morgan Stanley | (24.957) |
| 1.434 | Cullen/Frost Bankers Inc | Barclays Bank | (1.463) | | | Bank of America | |
| 7.880 | Cullinan Oncology Inc | Bank of America | | (4.352) | CVRx Inc | Merrill Lynch | (1.285) |
| | | Merrill Lynch | 2.443 | (2.552) | CVRx Inc | Barclays Bank | 6.484 |
| 14.621 | Cullinan Oncology Inc | Barclays Bank | 16.229 | 18.389 | CVS Health Corp | HSBC | (434) |
| 4.852 | Cullinan Oncology Inc | Goldman Sachs | 1.504 | 36.948 | CVS Health Corp | Barclays Bank | (44.869) |
| 14.919 | Cullinan Oncology Inc | HSBC | 11.040 | 38.174 | CVS Health Corp | Goldman Sachs | (69.093) |
| 6.701 | Cullinan Oncology Inc | Morgan Stanley | 7.438 | 21.593 | CVS Health Corp | HSBC | (102.036) |
| 9.228 | Culp Inc | Barclays Bank | (3.691) | (554) | CVS Health Corp | Morgan Stanley | (52.687) |
| 10.063 | Culp Inc | Goldman Sachs | (7.245) | (1.434) | Cyclerion Therapeutics Inc | HSBC | 824 |
| 15.310 | Culp Inc | HSBC | (11.023) | (20.414) | Cyclerion Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 860 |
| 3.312 | Culp Inc | Morgan Stanley | (1.325) | (13.620) | Cymabay Therapeutics Inc | Barclays Bank | (4.083) |
| 3.500 | Cummins Inc | Bank of America | | (17.353) | Cymabay Therapeutics Inc | HSBC | 16.753 |
| | | Merrill Lynch | (50.960) | | | Bank of America | |
| 23.813 | Cummins Inc | Barclays Bank | (287.832) | (6.429) | Cytek Biosciences Inc | Merrill Lynch | (10.932) |
| 4.217 | Cummins Inc | Goldman Sachs | (46.947) | (17.223) | Cytek Biosciences Inc | Barclays Bank | (257) |
| 8.980 | Cummins Inc | HSBC | (170.454) | (23.795) | Cytek Biosciences Inc | HSBC | 54.776 |
| 4.827 | Cummins Inc | Morgan Stanley | (66.806) | (4.315) | Cytokinetics Inc | Morgan Stanley | (952) |
| 38.116 | Cumulus Media Inc 'A' | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 381 | (829) | Cytokinetics Inc | Merrill Lynch | 2.296 |
| 47.511 | Cumulus Media Inc 'A' | Barclays Bank | (475) | (14.712) | Cytokinetics Inc | Barclays Bank | 2.346 |
| 11.097 | Cumulus Media Inc 'A' | Goldman Sachs | 111 | (1.907) | Cytokinetics Inc | Goldman Sachs | 15.153 |
| 32.741 | Cumulus Media Inc 'A' | HSBC | 20.954 | (3.409) | Cytokinetics Inc | HSBC | 934 |
| 17.719 | CureVac NV | Barclays Bank | (8.151) | (5.451) | CytoSorbents Corp | Morgan Stanley | 9.647 |
| 2.277 | CureVac NV | Goldman Sachs | 683 | (46.950) | CytoSorbents Corp | Bank of America | |
| | | | | (14.430) | CytoSorbents Corp | Merrill Lynch | 2.780 |
| | | | | (3.901) | CytoSorbents Corp | Barclays Bank | 17.841 |
| | | | | (268) | Daily Journal Corp | Goldman Sachs | 7.359 |
| | | | | (360) | Daily Journal Corp | Morgan Stanley | 1.482 |
| | | | | (129) | Daily Journal Corp | Bank of America | |
| | | | | (80) | Daily Journal Corp | Merrill Lynch | (4.033) |
| | | | | | | Barclays Bank | 2.048 |
| | | | | | | HSBC | (2.602) |
| | | | | | | Morgan Stanley | 455 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (4.580) | Dakota Gold Corp | Morgan Stanley | 641 | (8.590) | Dell Technologies Inc 'C' | Barclays Bank | 12.971 |
| (11.962) | Daktronics Inc | Barclays Bank | (3.469) | 14.313 | Dell Technologies Inc 'C' | HSBC | 143 |
| (19.947) | Daktronics Inc | Morgan Stanley | (5.785) | (4.424) | Dell Technologies Inc 'C' | HSBC | (44) |
| 2.240 | Dana Inc | Bank of America | | 9.803 | Dell Technologies Inc 'C' | Morgan Stanley | (14.803) |
| | | Merrill Lynch | (912) | (7.230) | Dell Technologies Inc 'C' | Morgan Stanley | 10.917 |
| 24.677 | Dana Inc | Barclays Bank | (28.872) | (9.390) | Delta Air Lines Inc | Bank of America | |
| 12.262 | Dana Inc | Goldman Sachs | (10.569) | | | Merrill Lynch | (24.602) |
| 16.817 | Dana Inc | HSBC | (19.807) | (10.126) | Delta Air Lines Inc | Barclays Bank | (8.911) |
| 13.450 | Dana Inc | Morgan Stanley | (15.684) | (40.288) | Delta Air Lines Inc | Goldman Sachs | (105.555) |
| 8.649 | Danaher Corp | Barclays Bank | (56.651) | (914) | Delta Air Lines Inc | HSBC | (547) |
| 462 | Danaher Corp | Goldman Sachs | (1.021) | (12.601) | Delta Air Lines Inc | Morgan Stanley | (11.089) |
| 2.174 | Danaher Corp | HSBC | (31.545) | (7.914) | Delta Apparel Inc | Barclays Bank | (5.144) |
| 1.419 | Danaher Corp | Morgan Stanley | (9.294) | (1.823) | Delta Apparel Inc | Goldman Sachs | 346 |
| 5.555 | Darden Restaurants Inc | Bank of America | | (4.000) | Delta Apparel Inc | HSBC | 4.240 |
| | | Merrill Lynch | 41.496 | (8.580) | Delta Apparel Inc | Morgan Stanley | (5.577) |
| 25.588 | Darden Restaurants Inc | Goldman Sachs | 191.143 | (2.696) | Deluxe Corp | Bank of America | |
| 8.470 | Darden Restaurants Inc | HSBC | 77.246 | | | Merrill Lynch | (728) |
| 7.100 | Darden Restaurants Inc | Morgan Stanley | (13.277) | (1.179) | Deluxe Corp | Barclays Bank | 106 |
| (14.940) | DarioHealth Corp | Bank of America | | (12.076) | Deluxe Corp | Goldman Sachs | (3.261) |
| | | Merrill Lynch | (1.046) | (10.542) | Deluxe Corp | HSBC | (2.668) |
| (9.003) | DarioHealth Corp | Barclays Bank | 1.260 | (3.564) | Deluxe Corp | Morgan Stanley | 369 |
| (970) | Darling Ingredients Inc | Bank of America | | 10.398 | Denali Therapeutics Inc | Barclays Bank | (15.701) |
| | | Merrill Lynch | 621 | 7.386 | Denali Therapeutics Inc | HSBC | 25.408 |
| (3.369) | Darling Ingredients Inc | Barclays Bank | 8.153 | (13.371) | Denbury Inc | Bank of America | |
| (9.975) | Darling Ingredients Inc | Goldman Sachs | 6.384 | | | Merrill Lynch | 15.119 |
| (4.582) | Darling Ingredients Inc | HSBC | (21.215) | (13.312) | Denbury Inc | Barclays Bank | 12.911 |
| (2.564) | Daseke Inc | Barclays Bank | 128 | (2.255) | Denbury Inc | Goldman Sachs | 1.601 |
| (28.171) | Daseke Inc | Goldman Sachs | (2.535) | (23.881) | Denbury Inc | HSBC | (16.154) |
| (3.860) | Datadog Inc 'A' | Bank of America | | (8.993) | Denbury Inc | Morgan Stanley | 8.627 |
| | | Merrill Lynch | (24.801) | (2.848) | Denny's Corp | Bank of America | |
| (6.184) | Datadog Inc 'A' | Goldman Sachs | (39.732) | | | Merrill Lynch | (854) |
| 2.664 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Bank of America | | (19.529) | Denny's Corp | Barclays Bank | 5.273 |
| | | Merrill Lynch | (5.168) | (1.962) | Denny's Corp | Goldman Sachs | (589) |
| 8.608 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Barclays Bank | (15.064) | (3.049) | Denny's Corp | HSBC | (1.281) |
| 7.805 | Dave & Buster's Entertainment Inc | HSBC | (26.069) | (1.548) | Denny's Corp | Morgan Stanley | 418 |
| 2.359 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Morgan Stanley | (4.128) | (9.205) | DENTSPLY SIRONA Inc | Barclays Bank | 31.941 |
| 56 | Dave Inc | HSBC | 25 | (1.878) | DENTSPLY SIRONA Inc | Goldman Sachs | 9.390 |
| (14.287) | DaVita Inc | Barclays Bank | 86.151 | 5.049 | DENTSPLY SIRONA Inc | Morgan Stanley | (4.933) |
| (2.987) | DaVita Inc | Goldman Sachs | 9.230 | 9.631 | Design Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (7.945) | DaVita Inc | HSBC | (36.229) | | | Merrill Lynch | (6.934) |
| (1.814) | DaVita Inc | Morgan Stanley | 10.938 | 8.110 | Design Therapeutics Inc | Barclays Bank | (11.597) |
| 14.721 | Day One Biopharmaceuticals Inc | Bank of America | | 3.928 | Design Therapeutics Inc | HSBC | (5.931) |
| | | Merrill Lynch | (22.229) | (39.968) | Designer Brands Inc 'A' | Barclays Bank | 39.568 |
| 12.401 | Day One Biopharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (11.161) | (35.527) | Designer Brands Inc 'A' | Goldman Sachs | 39.435 |
| 1.440 | Decibel Therapeutics Inc | HSBC | 893 | (14.935) | Designer Brands Inc 'A' | Morgan Stanley | 14.786 |
| 26.578 | Deciphera Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (22.591) | (9.714) | Desktop Metal Inc 'A' | Barclays Bank | (748) |
| 491 | Deciphera Pharmaceuticals Inc | HSBC | (44) | (43.029) | Desktop Metal Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.012) |
| 2.720 | Deckers Outdoor Corp | Barclays Bank | 53.503 | (23.646) | Desktop Metal Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.182 |
| 1.577 | Deckers Outdoor Corp | Goldman Sachs | (24.680) | (31.807) | Destination XL Group Inc | Barclays Bank | (1.908) |
| 2.044 | Deckers Outdoor Corp | HSBC | (38.407) | (38.099) | Destination XL Group Inc | Goldman Sachs | 12.192 |
| 86 | Deere & Co | Bank of America | | (1.078) | Devon Energy Corp | HSBC | 5.023 |
| | | Merrill Lynch | (1.877) | 97 | Dexcom Inc | Goldman Sachs | (504) |
| 1.417 | Deere & Co | Barclays Bank | (17.174) | 1.011 | Dexcom Inc | HSBC | (5.120) |
| 7.595 | Deere & Co | HSBC | (242.053) | 2.877 | Dexcom Inc | Morgan Stanley | (14.040) |
| 900 | Deere & Co | Morgan Stanley | (10.908) | 8.589 | DHI Group Inc | Bank of America | |
| 14.448 | Definitive Healthcare Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 4.380 |
| | | Merrill Lynch | 3.756 | 32.331 | DHI Group Inc | Barclays Bank | 1.940 |
| 5.626 | Definitive Healthcare Corp | Goldman Sachs | 1.463 | 16.718 | DHI Group Inc | Goldman Sachs | 8.526 |
| 9.104 | Definitive Healthcare Corp | HSBC | (2.822) | 19.265 | DHI Group Inc | HSBC | 6.357 |
| 48.661 | Definitive Healthcare Corp | Morgan Stanley | 7.786 | 16.799 | DHI Group Inc | Morgan Stanley | 1.008 |
| (10.703) | Delek US Holdings Inc | Bank of America | | 4.375 | DHT Holdings Inc | Barclays Bank | (1.575) |
| | | Merrill Lynch | 2.997 | 48.390 | DHT Holdings Inc | Goldman Sachs | (21.292) |
| (247) | Dell Technologies Inc 'C' | Bank of America | | 20.525 | DHT Holdings Inc | HSBC | (7.389) |
| | | Merrill Lynch | (272) | 311 | DHT Holdings Inc | Morgan Stanley | (112) |
| | | | | 1.348 | Diamond Hill Investment Group Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 4.192 |
| | | | | 183 | Diamond Hill Investment Group Inc | Barclays Bank | 243 |
| | | | | 1.719 | Diamond Hill Investment Group Inc | Goldman Sachs | 5.346 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 345 | Diamond Hill Investment Group Inc | HSBC | 900 | 63 | Dillard's Inc 'A' | Goldman Sachs | (810) |
| 98 | Diamond Hill Investment Group Inc | Morgan Stanley | 130 | 1.041 | Dillard's Inc 'A' | HSBC | (11.562) |
| (29.624) | Diamond Offshore Drilling Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17.478 | 620 | Dillard's Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.767) |
| (41.842) | Diamond Offshore Drilling Inc | Barclays Bank | 55.650 | (14.931) | Dime Community Bancshares Inc | Barclays Bank | 10.302 |
| (40.137) | Diamond Offshore Drilling Inc | HSBC | 25.688 | (20.921) | Dime Community Bancshares Inc | Goldman Sachs | (14.854) |
| (11.089) | Diamond Offshore Drilling Inc | Morgan Stanley | 14.748 | 1.693 | Dine Brands Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.133) |
| 1.854 | Diamondback Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.486) | 7.818 | Dine Brands Global Inc | Barclays Bank | (47.064) |
| 3.492 | Diamondback Energy Inc | Barclays Bank | (18.752) | 2.378 | Dine Brands Global Inc | Goldman Sachs | (10.772) |
| 5.016 | Diamondback Energy Inc | Goldman Sachs | (9.430) | 4.047 | Dine Brands Global Inc | HSBC | (14.124) |
| 2.028 | Diamondback Energy Inc | Morgan Stanley | (10.890) | 2.439 | Dine Brands Global Inc | Morgan Stanley | (11.709) |
| (35.869) | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 12.195 | (846) | Diodes Inc | Bank of America Merrill Lynch | 242 |
| (2.459) | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Barclays Bank | 443 | (6.564) | Diodes Inc | Barclays Bank | 24.549 |
| (31.806) | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | HSBC | 22.196 | (5.963) | Diodes Inc | Goldman Sachs | (11.240) |
| (15.470) | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Morgan Stanley | 2.785 | (1.476) | Diodes Inc | HSBC | (3.263) |
| (2.901) | DICE Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.613 | (2.748) | Diodes Inc | Morgan Stanley | 10.278 |
| (1.524) | DICE Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 4.740 | 1.648 | Disc Medicine Inc | Goldman Sachs | 3.280 |
| (566) | DICE Therapeutics Inc | HSBC | 3.668 | (3.331) | Discover Financial Services | Barclays Bank | (6.996) |
| (6.970) | DICE Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 20.631 | (4.564) | Discover Financial Services | Morgan Stanley | (9.584) |
| 302 | Dick's Sporting Goods Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.869) | 22.022 | DISH Network Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 771 |
| 6.457 | Dick's Sporting Goods Inc | Barclays Bank | 13.947 | 27.191 | DISH Network Corp 'A' | Morgan Stanley | (4.758) |
| 2.843 | Dick's Sporting Goods Inc | Goldman Sachs | (27.009) | (1.640) | Distribution Solutions Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.591 |
| 5.300 | Dick's Sporting Goods Inc | HSBC | (66.144) | (1.640) | Distribution Solutions Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (46) |
| (8.188) | Diebold Nixdorf Inc | Bank of America Merrill Lynch | 789 | (6.052) | Distribution Solutions Group Inc | Barclays Bank | 13.920 |
| (33.648) | Diebold Nixdorf Inc | Goldman Sachs | 3.244 | (6.052) | Distribution Solutions Group Inc | Barclays Bank | (172) |
| (30.929) | Diebold Nixdorf Inc | HSBC | 5.066 | (55.623) | Diversey Holdings Ltd | Morgan Stanley | 286 |
| 2.305 | Digi International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.128 | (3.492) | DLH Holdings Corp | Goldman Sachs | 2.794 |
| 7.027 | Digi International Inc | Barclays Bank | 13.843 | (3.081) | DMC Global Inc | Goldman Sachs | 2.342 |
| 16.110 | Digi International Inc | Goldman Sachs | 63.796 | (26.584) | DocGo Inc | Barclays Bank | 4.401 |
| 2.491 | Digi International Inc | HSBC | 12.829 | (10.539) | DocGo Inc | Goldman Sachs | (3.056) |
| 604 | Digi International Inc | Morgan Stanley | 1.190 | (30.242) | DocGo Inc | HSBC | (17.518) |
| (22.892) | Digimarc Corp | Barclays Bank | 34.567 | (21.848) | DocGo Inc | Morgan Stanley | 3.671 |
| (5.281) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (12.040) | 4.451 | DocuSign Inc | Bank of America Merrill Lynch | 21.810 |
| (4.853) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (44.405) | 8.926 | DocuSign Inc | Barclays Bank | 4.909 |
| (17.972) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (40.976) | 4.884 | DocuSign Inc | Goldman Sachs | 23.932 |
| (1.856) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | (6.106) | 10.016 | DocuSign Inc | HSBC | 67.107 |
| (1.170) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (10.706) | 9.609 | DocuSign Inc | Morgan Stanley | 5.285 |
| (2.104) | Digital Turbine Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.301 | 270 | Dolby Laboratories Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 123.336 |
| (27.286) | Digital Turbine Inc | Barclays Bank | 141.887 | 1.210 | Dolby Laboratories Inc 'A' | Barclays Bank | (807) |
| (16.155) | Digital Turbine Inc | Goldman Sachs | 56.058 | 7.270 | Dolby Laboratories Inc 'A' | Goldman Sachs | (21.737) |
| (19.483) | Digital Turbine Inc | HSBC | 53.773 | 1.951 | Dolby Laboratories Inc 'A' | HSBC | (5.053) |
| (65.475) | DigitalBridge Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (112.288) | 594 | Dolby Laboratories Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.218) |
| (9.740) | DigitalBridge Group Inc | HSBC | (13.779) | (8.186) | Dollar General Corp | Bank of America Merrill Lynch | 90.875 |
| (16.466) | DigitalBridge Group Inc | Morgan Stanley | (13.170) | (9.476) | Dollar General Corp | Barclays Bank | 30.134 |
| 4.166 | DigitalOcean Holdings Inc | Goldman Sachs | 18.122 | (2.050) | Dollar General Corp | Goldman Sachs | 147.155 |
| 7.713 | DigitalOcean Holdings Inc | HSBC | 32.472 | (8.546) | Dollar General Corp | HSBC | 29.499 |
| 83 | Dillard's Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.067) | (3.684) | Dollar General Corp | Morgan Stanley | 176.671 |
| 1.181 | Dillard's Inc 'A' | Barclays Bank | (12.153) | (7.859) | Dollar Tree Inc | Barclays Bank | 3.850 |
| | | | | (178) | Dollar Tree Inc | Goldman Sachs | 69.554 |
| | | | | (3.478) | Dollar Tree Inc | HSBC | 122.426 |
| | | | | (5.446) | Dollar Tree Inc | Morgan Stanley | 1.956 |
| | | | | (374) | Dominion Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 160.203 |
| | | | | (61.146) | Dominion Energy Inc | Barclays Bank | 185.963 |
| | | | | (35.557) | Dominion Energy Inc | Goldman Sachs | 121.981 |
| | | | | (17.526) | Dominion Energy Inc | HSBC | 61.479 |
| | | | | (23.465) | Dominion Energy Inc | Morgan Stanley | 54.978 |
| | | | | 3.321 | Domino's Pizza Inc | Bank of America Merrill Lynch | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.120 | Domino's Pizza Inc | Barclays Bank | (34.480) | (7.301) | Dril-Quip Inc | Barclays Bank | 12.850 |
| 521 | Domino's Pizza Inc | Goldman Sachs | (7.746) | (16.604) | Dril-Quip Inc | Goldman Sachs | 27.065 |
| 1.619 | Domino's Pizza Inc | HSBC | (27.697) | (3.953) | Dril-Quip Inc | HSBC | 6.265 |
| 1.413 | Domino's Pizza Inc | Morgan Stanley | (23.979) | (8.966) | Dril-Quip Inc | Morgan Stanley | 15.780 |
| 4.355 | Domo Inc 'B' | Bank of America | | (8.183) | Driven Brands Holdings Inc | Barclays Bank | 8.265 |
| | | Merrill Lynch | (4.181) | (12.861) | Driven Brands Holdings Inc | Goldman Sachs | 44.885 |
| 10.519 | Domo Inc 'B' | Barclays Bank | (18.934) | (7.690) | Driven Brands Holdings Inc | Morgan Stanley | 7.767 |
| 4.333 | Domo Inc 'B' | Goldman Sachs | (4.160) | 45.569 | Dropbox Inc 'A' | Bank of America | |
| 2.660 | Domo Inc 'B' | HSBC | (1.144) | | Merrill Lynch | | 16.090 |
| 33.653 | Donaldson Co Inc | Barclays Bank | (149.419) | 17.638 | Dropbox Inc 'A' | Barclays Bank | 7.055 |
| 19.283 | Donaldson Co Inc | Goldman Sachs | (73.083) | 7.666 | Dropbox Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.367 |
| 40.003 | Donaldson Co Inc | HSBC | (164.468) | 59.902 | Dropbox Inc 'A' | HSBC | 59.342 |
| 9.329 | Donaldson Co Inc | Morgan Stanley | (41.421) | 22.850 | Dropbox Inc 'A' | Morgan Stanley | 16.226 |
| 343 | Donegal Group Inc 'A' | Bank of America | | 2.262 | DTE Energy Co | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 98 | | Merrill Lynch | | (14.285) |
| 35.388 | Donegal Group Inc 'A' | Barclays Bank | (4.777) | 75.804 | DTE Energy Co | Barclays Bank | (187.615) |
| 8.756 | Donegal Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.495 | 44.219 | DTE Energy Co | Goldman Sachs | (279.243) |
| 24.366 | Donegal Group Inc 'A' | HSBC | 9.868 | 40.322 | DTE Energy Co | HSBC | (264.714) |
| 25.538 | Donegal Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.448) | (8.286) | DTE Midstream LLC | Barclays Bank | 12.098 |
| (7.686) | Donnelley Financial Solutions Inc | Barclays Bank | 10.530 | (7.002) | DTE Midstream LLC | Goldman Sachs | 16.805 |
| (1.539) | Donnelley Financial Solutions Inc | Barclays Bank | | 1.991 | DTE Midstream LLC | Goldman Sachs | (275) |
| 377 | DoorDash Inc 'A' | Bank of America | | 22.283 | Duckhorn Portfolio Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 46 | | Merrill Lynch | | (23.888) |
| (6.285) | DoorDash Inc 'A' | Barclays Bank | (858) | 12.617 | Duckhorn Portfolio Inc | Barclays Bank | (5.930) |
| 2.378 | DoorDash Inc 'A' | HSBC | 8.799 | 17.048 | Duckhorn Portfolio Inc | Goldman Sachs | (19.435) |
| (3.598) | DoorDash Inc 'A' | HSBC | (2.865) | 18.219 | Duckhorn Portfolio Inc | HSBC | (29.697) |
| 3.532 | DoorDash Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.945) | 29.818 | Duckhorn Portfolio Inc | Morgan Stanley | (14.014) |
| (16.361) | Dorian LPG Ltd | Barclays Bank | 8.508 | 1.644 | Ducommun Inc | Bank of America | |
| (3.476) | Dorian LPG Ltd | Goldman Sachs | (6.187) | | Merrill Lynch | | (12.281) |
| (2.616) | Dorman Products Inc | Bank of America | | 19.328 | Ducommun Inc | Barclays Bank | (25.126) |
| | | Merrill Lynch | 2.806 | 11.278 | Ducommun Inc | Goldman Sachs | (84.247) |
| (1.535) | Dorman Products Inc | Barclays Bank | 706 | 7.144 | Ducommun Inc | HSBC | (55.366) |
| (680) | Dorman Products Inc | Goldman Sachs | 850 | 1.351 | Ducommun Inc | Morgan Stanley | (1.756) |
| (1.957) | Dorman Products Inc | HSBC | 3.459 | (69.972) | Duke Energy Corp | Barclays Bank | 269.392 |
| (2.268) | Dorman Products Inc | Morgan Stanley | 1.560 | (1.308) | Duke Energy Corp | Goldman Sachs | 10.739 |
| (1.618) | DoubleVerify Holdings Inc | Bank of America | | (43.827) | Duke Energy Corp | HSBC | 472.455 |
| | | Merrill Lynch | (2.368) | (50.215) | Duke Energy Corp | Morgan Stanley | 193.328 |
| (25.403) | DoubleVerify Holdings Inc | Goldman Sachs | (149.878) | 22.841 | Duluth Holdings Inc 'B' | Bank of America | |
| (17.021) | DoubleVerify Holdings Inc | Morgan Stanley | (45.787) | | Merrill Lynch | | 2.284 |
| 9.354 | Douglas Dynamics Inc | Barclays Bank | (8.044) | 16.652 | Duluth Holdings Inc 'B' | Barclays Bank | (333) |
| 7.599 | Douglas Dynamics Inc | Goldman Sachs | 7.371 | 14.906 | Duluth Holdings Inc 'B' | Goldman Sachs | 1.491 |
| 1.010 | Douglas Dynamics Inc | HSBC | 1.545 | 21.882 | Duluth Holdings Inc 'B' | HSBC | 1.532 |
| (39.744) | Douglas Elliman Inc | Bank of America | | 22.145 | Duluth Holdings Inc 'B' | Morgan Stanley | (443) |
| | | Merrill Lynch | (2.385) | 8.822 | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Bank of America | |
| (20.802) | Douglas Elliman Inc | Barclays Bank | 3.536 | | Merrill Lynch | | (6.264) |
| (29.002) | Douglas Elliman Inc | Goldman Sachs | (1.740) | 62.219 | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Barclays Bank | (37.331) |
| (21.318) | Douglas Elliman Inc | HSBC | (5.543) | (23.035) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Goldman Sachs | 16.355 |
| (28.650) | Douglas Elliman Inc | Morgan Stanley | 4.871 | 4.802 | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.881) |
| 14.066 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Barclays Bank | (1.125) | 840 | Duolingo Inc | Barclays Bank | 1.914 |
| 9.564 | Douglas Emmett Inc (REIT) | Goldman Sachs | 8.416 | 1.860 | Duolingo Inc | Goldman Sachs | 16.573 |
| 26.920 | Douglas Emmett Inc (REIT) | HSBC | 2.961 | 531 | Duolingo Inc | HSBC | 2.850 |
| 1.023 | Dover Corp | Barclays Bank | (2.781) | 1.426 | Duolingo Inc | Morgan Stanley | 4.068 |
| 556 | Dover Corp | Morgan Stanley | (390) | 27.763 | DuPont de Nemours Inc | Barclays Bank | 16.658 |
| 1.634 | Dow Inc | Barclays Bank | (4.967) | 8.401 | DuPont de Nemours Inc | Goldman Sachs | 17.306 |
| 3.059 | Dow Inc | HSBC | (14.847) | (5.290) | Direct Corp | Bank of America | |
| 21.525 | Dow Inc | Morgan Stanley | (65.436) | | Merrill Lynch | | (6.613) |
| (3.953) | Doximity Inc 'A' | Bank of America | | (3.331) | Direct Corp | Barclays Bank | (300) |
| | | Merrill Lynch | 13.282 | (9.457) | Direct Corp | Goldman Sachs | (11.821) |
| (14.968) | Doximity Inc 'A' | Barclays Bank | 15.268 | (5.473) | DXC Technology Co | Bank of America | |
| (9.595) | Doximity Inc 'A' | HSBC | 34.159 | | Merrill Lynch | | (9.632) |
| (6.242) | Doximity Inc 'A' | Morgan Stanley | 6.367 | (4.544) | DXC Technology Co | Barclays Bank | (1.590) |
| (870) | DR Horton Inc | Bank of America | | (851) | DXC Technology Co | Goldman Sachs | (296) |
| | | Merrill Lynch | 2.925 | (7.497) | DXC Technology Co | HSBC | (19.342) |
| (918) | DR Horton Inc | Goldman Sachs | 1.149 | (35.157) | DXC Technology Co | Morgan Stanley | (12.305) |
| (25.263) | DR Horton Inc | HSBC | 42.442 | (11.791) | DXP Enterprises Inc | Barclays Bank | (590) |
| 10.727 | DraftKings Inc 'A' | Barclays Bank | (15.997) | (6.572) | DXP Enterprises Inc | Goldman Sachs | (10.121) |
| 8.029 | DraftKings Inc 'A' | HSBC | 1.321 | (1.574) | DXP Enterprises Inc | HSBC | (11.962) |
| 3.781 | DraftKings Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.655) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 72 | Dyadic International Inc | Barclays Bank | 9 | 4.321 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.414) |
| 2.059 | Dycom Industries Inc | Barclays Bank | 6.012 | | | | |
| 3.301 | Dycom Industries Inc | HSBC | 31.723 | 5.382 | EastGroup Properties Inc (REIT) | HSBC | (678) |
| (2.065) | Dynatrace Inc | Bank of America | | 1.372 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 4.354 |
| (14.418) | Dynatrace Inc | Merrill Lynch | (8.611) | | | | |
| (1.695) | Dynatrace Inc | Barclays Bank | (22.925) | 512 | Eastman Chemical Co | Bank of America | |
| (14.751) | Dynavax Technologies Corp | Morgan Stanley | (2.695) | | | Merrill Lynch | (1.060) |
| (6.050) | Dynavax Technologies Corp | Barclays Bank | (4.573) | 15.184 | Eastman Chemical Co | Barclays Bank | (72.276) |
| (13.872) | Dynavax Technologies Corp | Goldman Sachs | 968 | 7.103 | Eastman Chemical Co | Goldman Sachs | (14.703) |
| (3.736) | Dynavax Technologies Corp | HSBC | (5.410) | 11.873 | Eastman Chemical Co | HSBC | (32.287) |
| 15.560 | Dyne Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.158) | 1.173 | Eastman Chemical Co | Morgan Stanley | (5.583) |
| 4.375 | Dyne Therapeutics Inc | Barclays Bank | (15.716) | (141.520) | Eastman Kodak Co | Barclays Bank | (46.702) |
| (88.325) | Dynex Capital Inc (REIT) | HSBC | (3.150) | (25.776) | Eastman Kodak Co | HSBC | (42.788) |
| (25.514) | Dynex Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | (23.848) | (3.081) | Eaton Corp Plc | Bank of America | |
| (12.709) | DZS Inc | Morgan Stanley | (6.889) | | | Merrill Lynch | (27.698) |
| (9.781) | DZS Inc | Barclays Bank | 6.100 | 17.620 | Eaton Corp Plc | Barclays Bank | 83.343 |
| (2.309) | DZS Inc | Goldman Sachs | 4.206 | (222) | Eaton Corp Plc | Barclays Bank | (1.050) |
| (5.163) | DZS Inc | HSBC | 716 | (2.572) | Eaton Corp Plc | Goldman Sachs | (23.122) |
| (19.317) | E2open Parent Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.478 | 5.176 | Eaton Corp Plc | HSBC | 46.739 |
| | | Bank of America | | 7.677 | eBay Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (10.045) | | | Merrill Lynch | (18.425) |
| (23.323) | E2open Parent Holdings Inc | Barclays Bank | (8.630) | 11.001 | eBay Inc | Barclays Bank | (15.292) |
| (127.031) | E2open Parent Holdings Inc | Goldman Sachs | (66.056) | 57.139 | eBay Inc | Goldman Sachs | (137.134) |
| (7.150) | E2open Parent Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.646) | 46.722 | eBay Inc | HSBC | (162.593) |
| (1.304) | Eagle Bancorp Inc | Bank of America | | 7.219 | eBay Inc | Morgan Stanley | (10.034) |
| | | Merrill Lynch | (3.169) | (12.312) | Ebix Inc | Bank of America | |
| (1.327) | Eagle Bancorp Inc | Barclays Bank | 173 | | | Merrill Lynch | (52.818) |
| 4.259 | Eagle Bancorp Montana Inc | Bank of America | | (15.070) | Ebix Inc | Barclays Bank | (22.454) |
| | | Merrill Lynch | 3.407 | (3.004) | Ebix Inc | HSBC | (9.973) |
| 8.402 | Eagle Bancorp Montana Inc | Barclays Bank | (3.781) | (3.496) | Ebix Inc | Morgan Stanley | (5.209) |
| 11.763 | Eagle Bancorp Montana Inc | Goldman Sachs | 9.410 | 10.531 | EchoStar Corp 'A' | Bank of America | |
| 5.909 | Eagle Bancorp Montana Inc | HSBC | 2.423 | | | Merrill Lynch | 2.527 |
| 13.400 | Eagle Bancorp Montana Inc | Morgan Stanley | (6.030) | 40.029 | EchoStar Corp 'A' | Barclays Bank | 4.803 |
| (12.214) | Eagle Bulk Shipping Inc | Barclays Bank | 33.588 | 25.381 | EchoStar Corp 'A' | Goldman Sachs | 6.091 |
| (1.530) | Eagle Bulk Shipping Inc | Goldman Sachs | 3.228 | 14.709 | EchoStar Corp 'A' | HSBC | 4.742 |
| (1.969) | Eagle Bulk Shipping Inc | Morgan Stanley | 5.415 | 9.113 | EchoStar Corp 'A' | Morgan Stanley | 1.094 |
| (43.248) | Eagle Materials Inc | Barclays Bank | 156.558 | 17.720 | Ecolab Inc | Barclays Bank | (153.632) |
| (3.261) | Eagle Materials Inc | Goldman Sachs | (12.555) | 5.860 | Ecolab Inc | Goldman Sachs | (55.260) |
| (1.791) | Eagle Materials Inc | HSBC | (6.286) | 38.997 | Ecolab Inc | HSBC | (331.865) |
| (1.667) | Eagle Materials Inc | Morgan Stanley | 6.035 | 3.586 | Ecolab Inc | Morgan Stanley | (31.090) |
| 3.374 | Eagle Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (1.788) | (8.243) | Ecovyst Inc | Bank of America | |
| 3.607 | Eagle Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (848) | | | Merrill Lynch | 2.576 |
| 2.702 | Eagle Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.432) | (20.485) | Ecovyst Inc | Barclays Bank | 18.142 |
| (7.416) | Earthstone Energy Inc 'A' | Bank of America | | (11.427) | Ecovyst Inc | HSBC | 3.241 |
| | | Merrill Lynch | 4.598 | (18.011) | Ecovyst Inc | Morgan Stanley | 17.831 |
| (30.524) | Earthstone Energy Inc 'A' | Barclays Bank | 39.376 | (5.976) | Edgewell Personal Care Co | Bank of America | |
| (63.543) | Earthstone Energy Inc 'A' | Morgan Stanley | 79.813 | | | Merrill Lynch | 25.637 |
| 9.399 | East West Bancorp Inc | Goldman Sachs | 23.028 | (19.707) | Edgewell Personal Care Co | Barclays Bank | 63.259 |
| 2.288 | East West Bancorp Inc | HSBC | 10.136 | (11.503) | Edgewell Personal Care Co | Goldman Sachs | 49.348 |
| (49.581) | Easterly Government Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (12.395) | (2.443) | Edgewell Personal Care Co | HSBC | 8.404 |
| (43.491) | Easterly Government Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 5.219 | 8.055 | Edgewise Therapeutics Inc | Barclays Bank | 3.222 |
| (24.056) | Easterly Government Properties Inc (REIT) | HSBC | 10.585 | 6.046 | Edgewise Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 6.469 |
| (15.864) | Easterly Government Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (3.966) | 2.197 | Edgewise Therapeutics Inc | HSBC | 461 |
| (13.581) | Eastern Bankshares Inc | Barclays Bank | 9.099 | (12.717) | Edgio Inc | Barclays Bank | 766 |
| (2.944) | Eastern Bankshares Inc | Morgan Stanley | 1.972 | (16.804) | Edgio Inc | Goldman Sachs | 1.227 |
| (14.175) | Eastern Co | Bank of America | | (30.939) | Edgio Inc | HSBC | 3.010 |
| | | Merrill Lynch | 3.189 | (5.238) | Edgio Inc | Morgan Stanley | 315 |
| (11.685) | Eastern Co | Barclays Bank | 10.341 | (9.233) | Edison International | Bank of America | |
| (14.491) | Eastern Co | Goldman Sachs | 3.260 | (27.517) | Edison International | Merrill Lynch | 51.536 |
| (2.590) | Eastern Co | HSBC | 583 | (10.961) | Edison International | Barclays Bank | 34.947 |
| (173) | Eastern Co | Morgan Stanley | 153 | (10.970) | Edison International | HSBC | 76.629 |
| 2.117 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 12.010 | 22.868 | Editas Medicine Inc | Morgan Stanley | 13.932 |
| 7.551 | EastGroup Properties Inc (REIT) | Bank of America | | 2.889 | Editas Medicine Inc | Barclays Bank | (13.721) |
| | | Merrill Lynch | | 11.689 | Editas Medicine Inc | Goldman Sachs | (2.802) |
| | | Barclays Bank | 19.784 | 8.262 | Edwards Lifesciences Corp | HSBC | (6.780) |
| | | | | | | Bank of America | |
| | | | | 4.762 | Edwards Lifesciences Corp | Merrill Lynch | (61.056) |
| | | | | 8.101 | Edwards Lifesciences Corp | Barclays Bank | (36.334) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (59.866) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 5.705 | Edwards Lifesciences Corp | HSBC | (42.730) | (18.725) | Ellington Residential Mortgage (REIT) | Goldman Sachs | (936) |
| 4.061 | Edwards Lifesciences Corp | Morgan Stanley | (30.985) | (9.912) | Ellington Residential Mortgage (REIT) | HSBC | 496 |
| 3.271 | eGain Corp | Bank of America | | (8.968) | Ellington Residential Mortgage (REIT) | Morgan Stanley | 2.152 |
| | | Merrill Lynch | 1.112 | 1.132 | Elme Communities (REIT) | Bank of America | |
| 11.983 | eGain Corp | Barclays Bank | 1.678 | 51.231 | Elme Communities (REIT) | Merrill Lynch | (1.257) |
| 23.122 | eGain Corp | Goldman Sachs | 7.861 | 6.887 | Elme Communities (REIT) | Goldman Sachs | (56.866) |
| 5.960 | eGain Corp | HSBC | (1.192) | 23.236 | Elme Communities (REIT) | HSBC | (9.022) |
| 751 | eHealth Inc | Bank of America | | 6.510 | Embeckta Corp | Morgan Stanley | (16.265) |
| | | Merrill Lynch | (511) | 1.199 | Embeckta Corp | Barclays Bank | 1.172 |
| 8.411 | eHealth Inc | Barclays Bank | (8.411) | (14.524) | Embeckta Corp | Goldman Sachs | (2.014) |
| 4.900 | eHealth Inc | Goldman Sachs | (3.332) | 10.340 | EMCOR Group Inc | HSBC | 33.405 |
| 3.309 | eHealth Inc | HSBC | (629) | 11.133 | EMCOR Group Inc | Barclays Bank | 55.423 |
| 5.496 | eHealth Inc | Morgan Stanley | (5.496) | (2.089) | EMCOR Group Inc | Goldman Sachs | (9.756) |
| (16.841) | Eiger BioPharmaceuticals Inc | Bank of America | | 8.263 | EMCOR Group Inc | HSBC | 31.399 |
| (18.177) | Eiger BioPharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 2.695 | 2.662 | EMCOR Group Inc | Morgan Stanley | 14.269 |
| (23.334) | Eiger BioPharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 1.999 | (21.126) | EMCORE Corp | Bank of America | |
| 16.204 | El Pollo Loco Holdings Inc | Bank of America | | (9.946) | EMCORE Corp | Merrill Lynch | 2.960 |
| | | Merrill Lynch | (6.644) | (31.130) | EMCORE Corp | Barclays Bank | 1.251 |
| 53.395 | El Pollo Loco Holdings Inc | Barclays Bank | (26.964) | (7.503) | EMCORE Corp | Goldman Sachs | 4.361 |
| 39.110 | El Pollo Loco Holdings Inc | Goldman Sachs | (16.035) | 35.290 | Emerald Holding Inc | HSBC | 1.801 |
| 12.380 | El Pollo Loco Holdings Inc | HSBC | — | 7.335 | Emerald Holding Inc | Bank of America | |
| 40.755 | El Pollo Loco Holdings Inc | Morgan Stanley | (19.222) | 9.885 | Emergent BioSolutions Inc | Merrill Lynch | 1.059 |
| 98 | Elah Holdings Inc | Bank of America | | 645 | Emergent BioSolutions Inc | HSBC | 513 |
| | | Merrill Lynch | (345) | 17.495 | Emergent BioSolutions Inc | Barclays Bank | (1.779) |
| 87 | Elah Holdings Inc | Morgan Stanley | (220) | 37.687 | Emerson Electric Co | Goldman Sachs | (581) |
| 13.920 | Elanco Animal Health Inc | Bank of America | | 1.838 | Emerson Electric Co | HSBC | (12.771) |
| | | Merrill Lynch | (3.299) | 5.006 | Emerson Electric Co | Barclays Bank | (173.737) |
| 33.488 | Elanco Animal Health Inc | Barclays Bank | (15.552) | (7.143) | Empire Petroleum Corp | Goldman Sachs | (11.065) |
| 9.737 | Elanco Animal Health Inc | Goldman Sachs | (8.666) | (600) | Empire Petroleum Corp | HSBC | (33.590) |
| 86.333 | Elanco Animal Health Inc | HSBC | (114.529) | 108.514 | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America | 11.357 |
| 66.677 | Elanco Animal Health Inc | Morgan Stanley | (30.978) | 3.937 | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 936 |
| (1.315) | Elastic NV | Bank of America | | 48.496 | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | 30.384 |
| | | Merrill Lynch | (8.049) | (16.499) | Enact Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.890 |
| 5.817 | Elastic NV | Barclays Bank | 41.243 | 820 | Enanta Pharmaceuticals Inc | HSBC | 18.913 |
| (874) | Elastic NV | Barclays Bank | (403) | | Enanta Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (9.734) |
| (528) | Elastic NV | HSBC | (1.954) | 6.080 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Bank of America | (1.689) |
| (573) | Elastic NV | Morgan Stanley | (3.513) | 1.478 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (1.689) |
| (11.484) | Electromed Inc | Goldman Sachs | 2.584 | 2.421 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (12.525) |
| (3.329) | Electromed Inc | HSBC | (2.647) | (2.382) | Enbridge Inc | HSBC | (15.549) |
| 262 | Electronic Arts Inc | Bank of America | | (8.380) | Encompass Health Corp | Morgan Stanley | (8.716) |
| | | Merrill Lynch | 438 | (8.935) | Encompass Health Corp | Bank of America | 7.718 |
| 373 | Electronic Arts Inc | Goldman Sachs | 623 | (2.937) | Encompass Health Corp | Merrill Lynch | (1.142) |
| 1.001 | Electronic Arts Inc | HSBC | 1.094 | (11.580) | Encompass Health Corp | Barclays Bank | 7.070 |
| 3.322 | Electronic Arts Inc | Morgan Stanley | 4.618 | (4.372) | Encore Capital Group Inc | HSBC | 3.319 |
| 3.007 | Element Solutions Inc | Bank of America | | (11.032) | Encore Capital Group Inc | Morgan Stanley | 7.448 |
| (38.376) | Element Solutions Inc | Merrill Lynch | 271 | (7.031) | Encore Capital Group Inc | Barclays Bank | 4.853 |
| 12.793 | Element Solutions Inc | Barclays Bank | 26.479 | 360 | Encore Wire Corp | Goldman Sachs | 9.377 |
| 2.716 | Element Solutions Inc | Barclays Bank | (8.827) | 971 | Encore Wire Corp | Morgan Stanley | 7.804 |
| 2.340 | Element Solutions Inc | HSBC | (655) | 927 | Encore Wire Corp | Bank of America | |
| 5.479 | Element Solutions Inc | Morgan Stanley | (3.781) | 144 | Encore Wire Corp | Merrill Lynch | 703 |
| 4.660 | Elevance Health Inc | Bank of America | | 7.462 | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 2.767 |
| | | Merrill Lynch | (37.000) | 10.425 | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | HSBC | 2.673 |
| 10.429 | Elevance Health Inc | Barclays Bank | (129.633) | 11.501 | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 723 |
| 7.434 | Elevance Health Inc | Barclays Bank | (8.827) | | | Bank of America | |
| 4.334 | Elevance Health Inc | Goldman Sachs | 244 | | | Merrill Lynch | (963) |
| 6.692 | Elevance Health Inc | HSBC | (89.193) | | | Barclays Bank | (5.838) |
| 484 | elf Beauty Inc | Morgan Stanley | (83.181) | | | Goldman Sachs | (88) |
| | | Bank of America | | | | | |
| 19.791 | elf Beauty Inc | Bank of America | | | | | |
| (2.731) | Eli Lilly & Co | Merrill Lynch | 6.113 | | | | |
| | | Barclays Bank | 360.988 | | | | |
| (2.705) | Eli Lilly & Co | Bank of America | 27.243 | | | | |
| (2.803) | Eli Lilly & Co | Merrill Lynch | 25.102 | | | | |
| (4.940) | Eli Lilly & Co | Barclays Bank | 25.102 | | | | |
| (13.910) | Ellington Residential Mortgage (REIT) | HSBC | 22.452 | | | | |
| | | Morgan Stanley | 45.844 | | | | |
| | | Barclays Bank | 3.338 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 10.365 | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | HSBC | (11.564) | 2.558 | Enovis Corp | Bank of America | |
| 24.326 | Endo International Plc | Barclays Bank | (766) | 53.105 | Enovis Corp | Merrill Lynch | (1.164) |
| 34.982 | Endo International Plc | Goldman Sachs | (1.147) | 8.598 | Enovis Corp | Barclays Bank | (207.110) |
| (13.095) | Enerflex Ltd | Barclays Bank | 7.202 | 5.224 | Enovis Corp | Goldman Sachs | (38.777) |
| (11.288) | Enerflex Ltd | HSBC | 8.579 | 4.987 | Enovis Corp | HSBC | (9.019) |
| (3.688) | Energizer Holdings Inc | Bank of America | | (22.275) | Enovix Corp | Morgan Stanley | (3.866) |
| | | Merrill Lynch | 1.200 | | | Bank of America | |
| (14.400) | Energizer Holdings Inc | Barclays Bank | 26.640 | (8.572) | Enovix Corp | Merrill Lynch | (3.119) |
| (16.378) | Energizer Holdings Inc | Goldman Sachs | 41.436 | (6.417) | Enovix Corp | Barclays Bank | (7.115) |
| (3.280) | Energizer Holdings Inc | HSBC | 7.913 | (15.523) | Enovix Corp | Goldman Sachs | (898) |
| (2.030) | Energizer Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.832 | 2.915 | EnPro Industries Inc | Morgan Stanley | (12.884) |
| 11.417 | Energy Fuels Inc | Bank of America | | 5.469 | EnPro Industries Inc | Barclays Bank | 4.256 |
| | | Merrill Lynch | (5.794) | 19.985 | Ensign Group Inc | Morgan Stanley | 7.985 |
| 21.739 | Energy Fuels Inc | Barclays Bank | (13.913) | | | Bank of America | |
| 30.180 | Energy Fuels Inc | HSBC | (15.326) | 21.353 | Ensign Group Inc | Merrill Lynch | (81.972) |
| 7.121 | Energy Recovery Inc | Morgan Stanley | (7.691) | 16.880 | Ensign Group Inc | Barclays Bank | (87.120) |
| 5.527 | Enerpac Tool Group Corp | Barclays Bank | 2.156 | 8.237 | Ensign Group Inc | Goldman Sachs | (69.683) |
| 4.493 | Enerpac Tool Group Corp | Goldman Sachs | 6.335 | 10.477 | Ensign Group Inc | HSBC | (38.854) |
| 6.915 | Enerpac Tool Group Corp | HSBC | 15.351 | (149) | Enstar Group Ltd | Morgan Stanley | (42.746) |
| 4.994 | EnerSys | Bank of America | | (2.393) | Enstar Group Ltd | Barclays Bank | 3.177 |
| | | Merrill Lynch | 73.012 | (26.994) | Entegris Inc | HSBC | 15.339 |
| (4.333) | EnerSys | Barclays Bank | (52.819) | (14.400) | Entegris Inc | Barclays Bank | (279.118) |
| 2.969 | EnerSys | Barclays Bank | 33.944 | (5.446) | Entegris Inc | Goldman Sachs | (222.192) |
| (15.461) | EnerSys | Goldman Sachs | (226.040) | 5.088 | Entergy Corp | Morgan Stanley | (56.312) |
| 7.431 | EnerSys | Goldman Sachs | 108.641 | | | Bank of America | |
| (4.205) | EnerSys | HSBC | (60.552) | 25.039 | Entergy Corp | Merrill Lynch | (43.782) |
| (6.564) | EnerSys | Morgan Stanley | (80.015) | 11.366 | Entergy Corp | Barclays Bank | (89.765) |
| 1.716 | EnerSys | Morgan Stanley | 20.918 | 37.291 | Entergy Corp | Goldman Sachs | (97.804) |
| 2.373 | Eneti Inc | Bank of America | | 4.294 | Entergy Corp | HSBC | (375.707) |
| | | Merrill Lynch | 2.254 | 1.058 | Enterprise Bancorp Inc | Morgan Stanley | (15.394) |
| 12.435 | Eneti Inc | Barclays Bank | 3.606 | | | Bank of America | |
| 6.248 | Eneti Inc | Goldman Sachs | 5.936 | 4.254 | Enterprise Bancorp Inc | Merrill Lynch | (820) |
| 11.452 | Eneti Inc | Morgan Stanley | 3.321 | 12.551 | Enterprise Bancorp Inc | Barclays Bank | (5.934) |
| 15.522 | Enfusion Inc 'A' | Bank of America | | 680 | Enterprise Bancorp Inc | Goldman Sachs | (9.727) |
| | | Merrill Lynch | (931) | 16.791 | Enterprise Bancorp Inc | HSBC | (466) |
| 7.380 | Enfusion Inc 'A' | Barclays Bank | (1.033) | 14.714 | Enterprise Financial Services Corp | Morgan Stanley | (23.423) |
| 8.161 | Enfusion Inc 'A' | HSBC | (8.324) | | | Bank of America | |
| 11.922 | Enfusion Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.669) | 22.887 | Enterprise Financial Services Corp | Merrill Lynch | 38.551 |
| 8.212 | EngageSmart Inc | Bank of America | | 5.406 | Enterprise Financial Services Corp | Barclays Bank | 8.239 |
| | | Merrill Lynch | 10.429 | 14.501 | Enterprise Financial Services Corp | Goldman Sachs | 14.164 |
| 33.288 | EngageSmart Inc | Barclays Bank | (2.330) | 3.412 | Enterprise Financial Services Corp | HSBC | 37.993 |
| 28.826 | EngageSmart Inc | Goldman Sachs | 36.609 | 10.698 | Entravision Communications Corp 'A' | Morgan Stanley | 1.228 |
| 43.742 | EngageSmart Inc | HSBC | 90.486 | 30.379 | Entravision Communications Corp 'A' | Bank of America | (4.707) |
| 2.398 | EngageSmart Inc | Morgan Stanley | (168) | 14.393 | Entravision Communications Corp 'A' | Merrill Lynch | (10.329) |
| (20.511) | Enhabit Inc | Bank of America | | 8.904 | Entravision Communications Corp 'A' | Goldman Sachs | (6.333) |
| | | Merrill Lynch | 28.627 | (44.864) | Envela Corp | Morgan Stanley | (3.027) |
| (11.940) | Enhabit Inc | HSBC | 12.357 | (15.392) | Envela Corp | Bank of America | |
| (8.694) | Enhabit Inc | Morgan Stanley | 12.954 | (14.311) | Envela Corp | Merrill Lynch | (5.384) |
| 95.542 | EnLink Midstream LLC (Unit) | Barclays Bank | (15.287) | 13.887 | Envista Holdings Corp | Barclays Bank | (4.464) |
| 21.416 | EnLink Midstream LLC (Unit) | Goldman Sachs | 9.638 | (14.336) | Envista Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.717) |
| 70.041 | EnLink Midstream LLC (Unit) | HSBC | 65.839 | 8.691 | Envista Holdings Corp | Barclays Bank | (50.271) |
| 25.880 | EnLink Midstream LLC (Unit) | Morgan Stanley | (4.141) | (151) | Envista Holdings Corp | HSBC | 38.707 |
| 15.525 | Ennis Inc | Bank of America | | 12.370 | Envista Holdings Corp | Morgan Stanley | (23.466) |
| | | Merrill Lynch | (3.726) | 24.772 | Enviva Inc | Morgan Stanley | 547 |
| 17.343 | Ennis Inc | Barclays Bank | (8.325) | | | Bank of America | |
| 13.230 | Ennis Inc | Goldman Sachs | (3.175) | 9.814 | Enviva Inc | Merrill Lynch | 10.078 |
| 27.236 | Ennis Inc | HSBC | 14.112 | 7.427 | Enviva Inc | Barclays Bank | 1.374 |
| 11.496 | Ennis Inc | Morgan Stanley | (5.245) | 28.090 | Enviva Inc | Goldman Sachs | 3.862 |
| 2.485 | Enova International Inc | Bank of America | | (12.491) | Enzo Biochem Inc | Morgan Stanley | 3.933 |
| | | Merrill Lynch | 6.806 | (7.486) | Enzo Biochem Inc | Barclays Bank | 1.874 |
| 13.920 | Enova International Inc | Barclays Bank | 24.360 | | | HSBC | 2.545 |
| 16.716 | Enova International Inc | Goldman Sachs | 67.022 | | | | |
| 769 | Enova International Inc | HSBC | 3.947 | | | | |
| 1.569 | Enova International Inc | Morgan Stanley | 2.743 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 32.225 | EOG Resources Inc | Barclays Bank | (194.317) | 53.051 | Equity Residential (REIT) | Barclays Bank | (31.830) |
| 1.396 | EOG Resources Inc | HSBC | (9.549) | 66.146 | Equity Residential (REIT) | Goldman Sachs | (79.938) |
| 11.580 | EOG Resources Inc | Morgan Stanley | (69.827) | 10.039 | Equity Residential (REIT) | HSBC | (17.869) |
| (237) | EPAM Systems Inc | Bank of America | | 7.999 | Erasca Inc | Barclays Bank | (1.920) |
| | | Merrill Lynch | (4.726) | 6.393 | Erasca Inc | Goldman Sachs | (1.790) |
| 489 | EPAM Systems Inc | Bank of America | | 7.312 | Erasca Inc | HSBC | (1.316) |
| | | Merrill Lynch | 11.800 | (907) | Erie Indemnity Co 'A' | Bank of America | |
| (709) | EPAM Systems Inc | Barclays Bank | 4.984 | | | Merrill Lynch | 11.338 |
| 167 | EPAM Systems Inc | Goldman Sachs | 3.330 | (5.842) | Erie Indemnity Co 'A' | Barclays Bank | 58.887 |
| (92) | EPAM Systems Inc | HSBC | (2.283) | (1.652) | Erie Indemnity Co 'A' | Goldman Sachs | 20.651 |
| (318) | EPAM Systems Inc | Morgan Stanley | 2.236 | (2.480) | Erie Indemnity Co 'A' | HSBC | 35.067 |
| 6.296 | ePlus Inc | Bank of America | | (696) | Erie Indemnity Co 'A' | Morgan Stanley | 7.015 |
| | | Merrill Lynch | 40.861 | 2.782 | Ermenegildo Zegna NV | Bank of America | |
| 16.707 | ePlus Inc | Barclays Bank | 61.148 | | | Merrill Lynch | (3.505) |
| 2.637 | ePlus Inc | Goldman Sachs | 17.114 | 17.043 | Ermenegildo Zegna NV | Barclays Bank | (15.850) |
| 1.816 | ePlus Inc | HSBC | 13.856 | 31.943 | Ermenegildo Zegna NV | Goldman Sachs | (40.248) |
| 2.874 | ePlus Inc | Morgan Stanley | 10.519 | 16.224 | Ermenegildo Zegna NV | HSBC | (19.307) |
| (7.491) | EPR Properties (REIT) | Bank of America | | 13.697 | Ermenegildo Zegna NV | Morgan Stanley | (12.738) |
| | | Merrill Lynch | 3.896 | 8.279 | Eros Media World Plc | Bank of America | |
| (36.290) | EPR Properties (REIT) | Barclays Bank | 29.983 | | | Merrill Lynch | — |
| (18.978) | EPR Properties (REIT) | Goldman Sachs | 9.869 | 20.591 | Eros Media World Plc | Barclays Bank | — |
| (13.282) | EPR Properties (REIT) | HSBC | 12.485 | 20.674 | Eros Media World Plc | Goldman Sachs | — |
| (5.230) | EPR Properties (REIT) | Morgan Stanley | 4.393 | 2.838 | Eros Media World Plc | HSBC | — |
| (12.009) | EQRx Inc | Barclays Bank | 2.522 | 6.412 | Eros Media World Plc | Morgan Stanley | — |
| (28.332) | EQRx Inc | HSBC | 3.117 | (10.903) | Esab Corp | Barclays Bank | 6.869 |
| (4.650) | EQRx Inc | Morgan Stanley | 977 | (19.859) | Esab Corp | Goldman Sachs | 19.859 |
| (871) | EQT Corp | Bank of America | | (6.055) | Esab Corp | HSBC | (1.332) |
| | | Merrill Lynch | 44 | (1.361) | Esab Corp | Morgan Stanley | 857 |
| 4.158 | EQT Corp | Bank of America | | 25.192 | Esc War Ind TM | Barclays Bank | — |
| | | Merrill Lynch | (208) | 63.725 | Esc War Ind TM | Goldman Sachs | (2.226) |
| (6.071) | EQT Corp | Goldman Sachs | 304 | 41.059 | Esc War Ind TM | Morgan Stanley | — |
| 596 | EQT Corp | Goldman Sachs | 7 | (13.745) | Escalade Inc | Bank of America | |
| (1.691) | Equifax Inc | Barclays Bank | 9.838 | | | Merrill Lynch | (962) |
| (12.853) | Equifax Inc | Goldman Sachs | (42.029) | (5.486) | Escalade Inc | Barclays Bank | 1.481 |
| (31) | Equinix Inc (REIT) | HSBC | (713) | (8.717) | Escalade Inc | Goldman Sachs | (610) |
| (540) | Equinix Inc (REIT) | Morgan Stanley | (6.788) | (15.527) | Escalade Inc | Morgan Stanley | 4.192 |
| (12.079) | Equitable Holdings Inc | Bank of America | | (2.373) | ESCO Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (6.262) | | | Merrill Lynch | 7.481 |
| (67.123) | Equitable Holdings Inc | Barclays Bank | 27.023 | (8.864) | ESCO Technologies Inc | Barclays Bank | 32.620 |
| (8.672) | Equitable Holdings Inc | Goldman Sachs | (7.198) | (939) | ESCO Technologies Inc | Goldman Sachs | 4.770 |
| (11.812) | Equitable Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.961 | (2.407) | ESCO Technologies Inc | HSBC | 11.608 |
| 15.911 | Equitrans Midstream Corp | Bank of America | | (3.874) | ESCO Technologies Inc | Morgan Stanley | 12.961 |
| | | Merrill Lynch | 44.710 | (40.015) | Escrow New York (REIT) ¹ | Bank of America | |
| 31.915 | Equitrans Midstream Corp | Barclays Bank | 78.830 | | | Merrill Lynch | (749.081) |
| (14.339) | Equitrans Midstream Corp | Goldman Sachs | (40.293) | (39.940) | Escrow New York (REIT) ¹ | Goldman Sachs | (747.637) |
| 21.139 | Equitrans Midstream Corp | HSBC | 65.742 | (21.172) | Escrow New York (REIT) ¹ | Morgan Stanley | (396.340) |
| (41.936) | Equitrans Midstream Corp | HSBC | (130.421) | (59.220) | Esperion Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 71.290 | Equitrans Midstream Corp | Morgan Stanley | 176.086 | | | Merrill Lynch | 19.246 |
| 4.810 | Equity Bancshares Inc 'A' | Bank of America | | (13.378) | Esquire Financial Holdings Inc | Barclays Bank | (6.421) |
| | | Merrill Lynch | 6.686 | (4.085) | Esquire Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | (11.806) |
| 3.029 | Equity Bancshares Inc 'A' | Barclays Bank | (454) | (2.594) | Esquire Financial Holdings Inc | HSBC | (9.987) |
| 4.916 | Equity Bancshares Inc 'A' | Goldman Sachs | 6.833 | (18.213) | ESS Tech Inc | HSBC | (1.093) |
| 7.008 | Equity Bancshares Inc 'A' | HSBC | 12.054 | (17.136) | ESS Tech Inc | Morgan Stanley | 857 |
| 3.896 | Equity Bancshares Inc 'A' | Morgan Stanley | (584) | 2.693 | ESSA Bancorp Inc | Barclays Bank | 3.528 |
| (3.838) | Equity Commonwealth (REIT) | Bank of America | | 5.380 | ESSA Bancorp Inc | Goldman Sachs | 8.823 |
| | | Merrill Lynch | (192) | 15.627 | ESSA Bancorp Inc | HSBC | 12.502 |
| (39.767) | Equity Commonwealth (REIT) | Barclays Bank | 28.082 | 7.575 | ESSA Bancorp Inc | Morgan Stanley | 9.923 |
| (31.380) | Equity Commonwealth (REIT) | Goldman Sachs | (1.569) | 18.684 | Essent Group Ltd | Barclays Bank | 3.550 |
| (26.644) | Equity Commonwealth (REIT) | HSBC | 1.031 | 11.095 | Essent Group Ltd | Goldman Sachs | 5.437 |
| (35.146) | Equity Commonwealth (REIT) | Morgan Stanley | 24.105 | 2.418 | Essential Properties Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| 26.136 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (46.522) | 29.620 | Essential Properties Realty Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | (1.223) |
| 43.184 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (218.079) | 40.551 | Essential Properties Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (28.731) |
| 7.196 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (12.809) | 1.088 | Essential Properties Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | (49.067) |
| | | | | | | Morgan Stanley | 177 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 10.928 | Essential Utilities Inc | Bank of America | | 48.398 | Evergy Inc | HSBC | (235.214) |
| | | Merrill Lynch | (17.157) | 4.712 | Everi Holdings Inc | Bank of America | |
| 29.334 | Essential Utilities Inc | Barclays Bank | (2.347) | | | Merrill Lynch | (6.267) |
| 8.951 | Essential Utilities Inc | Goldman Sachs | (14.053) | 17.577 | Everi Holdings Inc | Barclays Bank | (21.092) |
| 13.223 | Essential Utilities Inc | HSBC | (31.735) | 47.485 | Everi Holdings Inc | Goldman Sachs | (62.984) |
| 21.563 | Essential Utilities Inc | Morgan Stanley | (1.725) | 14.795 | Everi Holdings Inc | HSBC | (18.276) |
| (966) | Essex Property Trust Inc (REIT) | | | 9.451 | Everi Holdings Inc | Morgan Stanley | (11.341) |
| | | Barclays Bank | (4.985) | 12.491 | EverQuote Inc 'A' | Barclays Bank | 3.123 |
| (236) | Essex Property Trust Inc (REIT) | | | 8.479 | EverQuote Inc 'A' | Goldman Sachs | 18.357 |
| | | Morgan Stanley | (1.218) | 4.095 | Eversource Energy | Bank of America | |
| (2.795) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (34.848) |
| | | Merrill Lynch | 22.578 | 31.384 | Eversource Energy | Barclays Bank | (138.717) |
| (3.515) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Barclays Bank | 33.309 | 48.230 | Eversource Energy | Goldman Sachs | (410.437) |
| (7.113) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Goldman Sachs | 107.264 | 36.379 | Eversource Energy | HSBC | (306.311) |
| (7.948) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | HSBC | 58.932 | 7.179 | Eversource Energy | Morgan Stanley | (31.731) |
| (5.668) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Morgan Stanley | 57.402 | (3.118) | Everspin Technologies Inc | Barclays Bank | (2.900) |
| 16.580 | Ethan Allen Interiors Inc | Barclays Bank | (26.694) | (7.448) | Everspin Technologies Inc | Goldman Sachs | (9.980) |
| 11.382 | Ethan Allen Interiors Inc | Goldman Sachs | (22.309) | (9.295) | EVERTEC Inc | Goldman Sachs | 10.596 |
| 6.854 | Ethan Allen Interiors Inc | HSBC | (12.543) | (2.995) | EVI Industries Inc | Barclays Bank | 2.516 |
| (17.433) | Eton Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (6.799) | 8.581 | Evolent Health Inc 'A' | Barclays Bank | (31.406) |
| 2.040 | Etsy Inc | Bank of America | | (6.639) | Evolus Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (31.253) | | | Merrill Lynch | 8.232 |
| 2.930 | Etsy Inc | Barclays Bank | (21.946) | (7.090) | Evolus Inc | Goldman Sachs | 8.792 |
| 875 | Etsy Inc | Goldman Sachs | (13.405) | (10.962) | Evolus Inc | HSBC | (1.644) |
| 9.327 | Etsy Inc | HSBC | (95.602) | (14.706) | Evolution Petroleum Corp | Goldman Sachs | (7.500) |
| 6.175 | Etsy Inc | Morgan Stanley | (46.251) | (3.617) | Evolv Technologies Holdings Inc | | |
| 2.623 | Euronet Worldwide Inc | Bank of America | | | | Goldman Sachs | (1.266) |
| | | Merrill Lynch | (4.643) | (57.260) | Evolv Technologies Holdings Inc | HSBC | (92.761) |
| 246 | Euronet Worldwide Inc | Barclays Bank | (2.534) | (30.621) | Evolv Technologies Holdings Inc | | |
| 1.542 | Euronet Worldwide Inc | Goldman Sachs | (2.730) | 5.822 | EW Scripps Co 'A' | Morgan Stanley | 10.411 |
| 5.795 | Euronet Worldwide Inc | HSBC | (14.140) | | | Bank of America | |
| 3.335 | Euronet Worldwide Inc | Morgan Stanley | (34.351) | 15.059 | EW Scripps Co 'A' | Merrill Lynch | 58 |
| (7.175) | European Wax Center Inc 'A' | Bank of America | | 2.695 | EW Scripps Co 'A' | Barclays Bank | (1.355) |
| | | Merrill Lynch | (1.721) | 2.107 | Exact Sciences Corp | Goldman Sachs | (261) |
| (14.417) | European Wax Center Inc 'A' | Barclays Bank | 1.526 | | | Bank of America | |
| (4.809) | European Wax Center Inc 'A' | | | (1.955) | Exact Sciences Corp | Merrill Lynch | (1.854) |
| | | Morgan Stanley | 63 | 207 | Exact Sciences Corp | Barclays Bank | 6.960 |
| 235 | Evans Bancorp Inc | Bank of America | | 6.019 | Exact Sciences Corp | Goldman Sachs | (182) |
| | | Merrill Lynch | (105) | | | Bank of America | |
| 13.647 | Evans Bancorp Inc | Barclays Bank | 614 | 5.145 | Exagen Inc | Merrill Lynch | 1.204 |
| 8.500 | Evans Bancorp Inc | Goldman Sachs | (3.783) | 8.829 | Exagen Inc | Barclays Bank | (669) |
| 2.287 | Evans Bancorp Inc | HSBC | (3.922) | 4.780 | Exagen Inc | Goldman Sachs | 1.766 |
| 4.196 | Evans Bancorp Inc | Morgan Stanley | 189 | (5.926) | Excelerate Energy Inc 'A' | HSBC | 860 |
| 34.387 | Eventbrite Inc 'A' | Barclays Bank | (6.534) | | | Bank of America | |
| 26.027 | Eventbrite Inc 'A' | Goldman Sachs | 7.027 | (6.810) | Excelerate Energy Inc 'A' | Merrill Lynch | 12.376 |
| 20.443 | Eventbrite Inc 'A' | HSBC | 17.990 | (4.555) | Excelerate Energy Inc 'A' | Barclays Bank | 8.798 |
| 6.672 | Everbridge Inc | Bank of America | | (16.209) | Excelerate Energy Inc 'A' | HSBC | 14.092 |
| | | Merrill Lynch | (10.141) | 932 | Exelixis Inc | Morgan Stanley | 20.616 |
| 4.994 | Everbridge Inc | Barclays Bank | (4.994) | | | Bank of America | |
| 9.413 | Everbridge Inc | Goldman Sachs | (14.308) | 42.599 | Exelixis Inc | Merrill Lynch | (373) |
| 9.788 | Everbridge Inc | HSBC | (5.579) | 51.401 | Exelixis Inc | Barclays Bank | (28.542) |
| 6.869 | Everbridge Inc | Morgan Stanley | (6.869) | 40.551 | Exelixis Inc | HSBC | 3.598 |
| (60.073) | EverCommerce Inc | Morgan Stanley | 19.824 | 8.046 | Exelon Corp | Morgan Stanley | (27.169) |
| 2.911 | Evercore Inc 'A' | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 3.639 | 3.954 | Exelon Corp | Merrill Lynch | (12.351) |
| 8.078 | Evercore Inc 'A' | Barclays Bank | (11.148) | (16.221) | Exelon Corp | Barclays Bank | (3.539) |
| 5.427 | Evercore Inc 'A' | Goldman Sachs | 6.784 | (6.940) | Exelon Corp | Barclays Bank | 14.518 |
| 5.197 | Evercore Inc 'A' | HSBC | 7.743 | 8.893 | Exelon Corp | Goldman Sachs | 775 |
| 9.955 | Evercore Inc 'A' | Morgan Stanley | (13.738) | (505) | Exelon Corp | HSBC | (6.625) |
| 2.320 | Everest Re Group Ltd | Bank of America | | 13.295 | Exelon Corp | HSBC | 143 |
| | | Merrill Lynch | (62.692) | 912 | ExlService Holdings Inc | Morgan Stanley | (11.899) |
| 6.261 | Everest Re Group Ltd | Barclays Bank | (69.097) | | | Bank of America | |
| 3.130 | Everest Re Group Ltd | Goldman Sachs | (90.781) | 10.926 | ExlService Holdings Inc | Merrill Lynch | (1.067) |
| 1.069 | Everest Re Group Ltd | HSBC | (24.536) | 4.306 | ExlService Holdings Inc | Barclays Bank | (54.084) |
| 2.311 | Everest Re Group Ltd | Morgan Stanley | (25.514) | 3.439 | ExlService Holdings Inc | Goldman Sachs | (5.038) |
| 528 | Evergy Inc | Bank of America | | 16.543 | ExlService Holdings Inc | HSBC | 2.555 |
| | | Merrill Lynch | (2.387) | 13.231 | eXp World Holdings Inc | Morgan Stanley | (81.889) |
| 4.692 | Evergy Inc | Barclays Bank | (8.821) | 10.523 | eXp World Holdings Inc | Goldman Sachs | 27.520 |
| 29.948 | Evergy Inc | Goldman Sachs | (135.365) | | | HSBC | 25.150 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.879) | Expedia Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.417 | 582 | FactSet Research Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.324) |
| (2.150) | Expedia Group Inc | Barclays Bank | 2.638 | 3.004 | FactSet Research Systems Inc | Barclays Bank | (28.989) |
| (1.355) | Expedia Group Inc | Goldman Sachs | (544) | 1.040 | FactSet Research Systems Inc | HSBC | (14.633) |
| 4.082 | Expedia Group Inc | HSBC | 8.491 | 928 | FactSet Research Systems Inc | Morgan Stanley | (8.955) |
| (689) | Expedia Group Inc | HSBC | 1.683 | 131 | Fair Isaac Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.641 |
| 7.684 | Expedia Group Inc | Morgan Stanley | (17.366) | (303) | Fair Isaac Corp | Barclays Bank | (4.497) |
| (2.532) | Expedia Group Inc | Morgan Stanley | (3.144) | 136 | Fair Isaac Corp | Barclays Bank | 2.018 |
| (13.624) | Expeditors International of Washington Inc | Bank of America Merrill Lynch | 26.704 | (227) | Fair Isaac Corp | Goldman Sachs | (8.043) |
| (5.757) | Expeditors International of Washington Inc | Barclays Bank | 21.301 | 57 | Fair Isaac Corp | Goldman Sachs | 1.502 |
| (437) | Expeditors International of Washington Inc | Goldman Sachs | 655 | 62 | Fair Isaac Corp | HSBC | 2.218 |
| (6.037) | Expeditors International of Washington Inc | HSBC | 29.628 | 245 | Fair Isaac Corp | Morgan Stanley | 3.636 |
| (10.740) | Expeditors International of Washington Inc | Morgan Stanley | 39.885 | (65.927) | Faraday Future Intelligent Electric Inc | Morgan Stanley | (1.220) |
| 23.854 | Expensify Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 18.845 | (2.282) | Farmer Bros Co | Goldman Sachs | 593 |
| 6.624 | Expensify Inc 'A' | Barclays Bank | (596) | (11.384) | Farmer Bros Co | Morgan Stanley | 3.188 |
| 7.505 | Expensify Inc 'A' | Goldman Sachs | 5.929 | (14.446) | Farmers & Merchants Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (27.592) |
| 40.729 | Expensify Inc 'A' | HSBC | (29.325) | (17.515) | Farmers & Merchants Bancorp Inc | Barclays Bank | 19.266 |
| 20.726 | Expensify Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.865) | (18.083) | Farmers National Banc Corp | Bank of America Merrill Lynch | (13.743) |
| 4.546 | Exponent Inc | Bank of America Merrill Lynch | 27.321 | (15.842) | Farmers National Banc Corp | Barclays Bank | (317) |
| 3.410 | Exponent Inc | Barclays Bank | 8.355 | (37.875) | Farmers National Banc Corp | HSBC | (25.348) |
| 11.094 | Exponent Inc | HSBC | 47.371 | (9.505) | Farmers National Banc Corp | Morgan Stanley | (190) |
| 10.667 | Exponent Inc | Morgan Stanley | 26.134 | (21.503) | Farmland Partners Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (12.619) |
| (13.914) | Express Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.145 | (38.187) | Farmland Partners Inc (REIT) | Barclays Bank | (8.783) |
| (68.444) | Express Inc | Goldman Sachs | 15.468 | (43.365) | Farmland Partners Inc (REIT) | Goldman Sachs | (25.152) |
| (28.132) | Express Inc | HSBC | 8.285 | (12.335) | Farmland Partners Inc (REIT) | HSBC | (8.157) |
| (2.896) | Expro Group Holdings NV | Barclays Bank | 2.896 | (38.910) | Farmland Partners Inc (REIT) | Morgan Stanley | (8.949) |
| (7.031) | Expro Group Holdings NV | Goldman Sachs | 10.054 | (4.875) | FARO Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (19.939) |
| (4.845) | Expro Group Holdings NV | HSBC | 5.669 | (8.272) | FARO Technologies Inc | Barclays Bank | (15.220) |
| (12.371) | Expro Group Holdings NV | Morgan Stanley | 12.371 | (7.377) | FARO Technologies Inc | Goldman Sachs | (30.172) |
| 2.312 | Extra Space Storage Inc (REIT) | Barclays Bank | (8.655) | (10.819) | FARO Technologies Inc | HSBC | (33.651) |
| 1.256 | Extra Space Storage Inc (REIT) | Morgan Stanley | (5.363) | (8.270) | FARO Technologies Inc | Morgan Stanley | (15.217) |
| 6.664 | Extreme Networks Inc | Bank of America Merrill Lynch | 22.524 | (64.263) | Fastenal Co | Barclays Bank | 82.257 |
| 10.826 | Extreme Networks Inc | Barclays Bank | 14.074 | (54.949) | Fastenal Co | HSBC | 12.638 |
| 29.695 | Extreme Networks Inc | Morgan Stanley | 38.603 | 13.265 | Fastly Inc 'A' | Barclays Bank | 36.346 |
| (5.041) | Exxon Mobil Corp | Bank of America Merrill Lynch | 12.451 | 13.628 | Fate Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.807) |
| (5.121) | Exxon Mobil Corp | Barclays Bank | 12.137 | 19.576 | Fate Therapeutics Inc | Barclays Bank | (4.502) |
| (1.552) | Exxon Mobil Corp | HSBC | (137) | 7.561 | Fate Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.495) |
| (15.152) | Exxon Mobil Corp | Morgan Stanley | 35.910 | 21.768 | Fate Therapeutics Inc | HSBC | (9.796) |
| 6.764 | Eyenovia Inc | HSBC | 1.457 | 19.807 | Fate Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (4.556) |
| (1.491) | EyePoint Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 60 | 72 | Fathom Holdings Inc | Barclays Bank | (12) |
| (133) | EyePoint Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 124 | 59 | Fathom Holdings Inc | Goldman Sachs | 11 |
| 10.689 | EZCORP Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.248) | 820 | FB Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.287 |
| 50.892 | EZCORP Inc 'A' | Barclays Bank | (11.451) | 28.830 | FB Financial Corp | Barclays Bank | (25.082) |
| 40.698 | EZCORP Inc 'A' | Goldman Sachs | (7.538) | 17 | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (31) |
| 15.378 | EZCORP Inc 'A' | Morgan Stanley | 269 | 7.124 | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Barclays Bank | (35.264) |
| 13.160 | F&G Annuities & Life Inc | Bank of America Merrill Lynch | 28.689 | 329 | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | HSBC | 1.995 |
| 4.046 | F&G Annuities & Life Inc | HSBC | 13.837 | 148 | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Morgan Stanley | (219) |
| 3.677 | F&G Annuities & Life Inc | Morgan Stanley | (809) | | | | |
| (78.014) | F45 Training Holdings Inc | Goldman Sachs | (13.262) | | | | |
| (1.622) | F5 Inc | Barclays Bank | (5.693) | | | | |
| (4.989) | F5 Inc | Goldman Sachs | (41.508) | | | | |
| (4.586) | F5 Inc | HSBC | (60.627) | | | | |
| 983 | F5 Inc | Morgan Stanley | 3.450 | | | | |
| 6.658 | Fabrinet | HSBC | 164.386 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 5.038 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (7.297) | (12.491) | Figs Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.497) |
| 12.412 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Barclays Bank | (16.111) | (15.926) | Finance Of America Cos Inc 'A' | HSBC | 637 |
| 10.181 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Goldman Sachs | (21.329) | (57.847) | Finance Of America Cos Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.735) |
| 2.973 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | HSBC | (12.248) | 23.544 | Financial Institutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.825 |
| 3.729 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Morgan Stanley | (11.034) | 31.296 | Financial Institutions Inc | Barclays Bank | (6.572) |
| 1.977 | Federal Signal Corp | Bank of America Merrill Lynch | (731) | 24.479 | Financial Institutions Inc | Goldman Sachs | 2.937 |
| 20.194 | Federal Signal Corp | Barclays Bank | (39.984) | 6.088 | Financial Institutions Inc | HSBC | 3.348 |
| 14.051 | Federal Signal Corp | Goldman Sachs | (5.199) | 8.306 | Financial Institutions Inc | Morgan Stanley | (1.744) |
| 854 | Federal Signal Corp | HSBC | (272) | 2.170 | Finwise Bancorp | Goldman Sachs | (195) |
| 929 | Federal Signal Corp | Morgan Stanley | (1.839) | 2.429 | Finwise Bancorp | HSBC | (874) |
| 8.734 | Federated Hermes Inc | Bank of America Merrill Lynch | (24.979) | (17.968) | First Advantage Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.234) |
| 2.965 | Federated Hermes Inc | Barclays Bank | (5.752) | (37.451) | First Advantage Corp | HSBC | (24.718) |
| (1.891) | Federated Hermes Inc | Goldman Sachs | 5.408 | (3.010) | First Advantage Corp | Morgan Stanley | 211 |
| 11.394 | Federated Hermes Inc | Goldman Sachs | (32.587) | (10.731) | First American Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 12.341 |
| (8.920) | Federated Hermes Inc | HSBC | 39.783 | (4.233) | First American Financial Corp | Barclays Bank | (1.947) |
| 2.450 | Federated Hermes Inc | HSBC | (8.644) | (75.974) | First American Financial Corp | HSBC | 225.643 |
| (1.149) | Federated Hermes Inc | Morgan Stanley | 2.229 | (13.185) | First Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (37.314) |
| 32.463 | Federated Hermes Inc | Morgan Stanley | (62.978) | (28.835) | First Bancorp | Barclays Bank | 4.902 |
| 685 | FedEx Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.802) | (19.772) | First Bancorp | Goldman Sachs | (55.955) |
| 2.344 | FedEx Corp | Barclays Bank | (18.566) | (15.908) | First Bancorp | HSBC | (39.611) |
| 976 | FedEx Corp | Morgan Stanley | (4.256) | (10.353) | First Bancorp | Morgan Stanley | 1.760 |
| 8.678 | Fennec Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (1.866) | (7.216) | First BanCorp | Bank of America Merrill Lynch | (433) |
| 23.394 | Fennec Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 1.287 | (2.587) | First BanCorp | Barclays Bank | 448 |
| (13.507) | Ferguson Plc | Barclays Bank | 61.592 | (1.852) | First BanCorp | HSBC | 228 |
| (20.829) | Ferguson Plc | Goldman Sachs | 31.243 | 9.170 | First Bancorp Inc | Barclays Bank | (6.144) |
| (14.236) | Ferguson Plc | HSBC | (72.888) | 6.410 | First Bancorp Inc | Goldman Sachs | 5.256 |
| (3.409) | Ferguson Plc | Morgan Stanley | 15.545 | 834 | First Bancorp Inc | HSBC | 676 |
| 3.605 | FibroGen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.911) | 9.026 | First Bancorp Inc | Morgan Stanley | (6.047) |
| 20.620 | FibroGen Inc | Goldman Sachs | (10.929) | 24.143 | First Bancshares Inc | Barclays Bank | 4.587 |
| 491 | Fidelity D&D Bancorp Inc | Barclays Bank | (489) | 5.165 | First Bancshares Inc | Goldman Sachs | 9.194 |
| 220 | Fidelity D&D Bancorp Inc | Goldman Sachs | (193) | 19.544 | First Bancshares Inc | HSBC | 27.166 |
| 264 | Fidelity D&D Bancorp Inc | HSBC | (912) | 44.526 | First Bank | Bank of America Merrill Lynch | 14.694 |
| 140 | Fidelity D&D Bancorp Inc | Morgan Stanley | (139) | 28.892 | First Bank | Barclays Bank | (5.778) |
| (3.187) | Fidelity National Financial Inc | Barclays Bank | 1.020 | 16.391 | First Bank | Goldman Sachs | 5.409 |
| (13.680) | Fidelity National Financial Inc | Goldman Sachs | (958) | 13.808 | First Bank | HSBC | 16.155 |
| (13.383) | Fidelity National Financial Inc | HSBC | (3.295) | 4.997 | First Bank | Morgan Stanley | (999) |
| (28.137) | Fidelity National Financial Inc | Morgan Stanley | 9.004 | 9.129 | First Busey Corp | Bank of America Merrill Lynch | 12.095 |
| 6.307 | Fidelity National Information Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.089) | 49.201 | First Busey Corp | Barclays Bank | 12.230 |
| 18.942 | Fidelity National Information Services Inc | Barclays Bank | (71.979) | 31.103 | First Busey Corp | Goldman Sachs | 46.032 |
| 16.425 | Fidelity National Information Services Inc | Goldman Sachs | (30.918) | 28.919 | First Busey Corp | HSBC | 41.395 |
| 12.802 | Fidelity National Information Services Inc | HSBC | (25.000) | 22.628 | First Busey Corp | Morgan Stanley | 5.883 |
| 16.573 | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley | (62.978) | 1.116 | First Business Financial Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.020 |
| 10.770 | Fiesta Restaurant Group Inc | Barclays Bank | (539) | 18.013 | First Business Financial Services Inc | Barclays Bank | (721) |
| 2.988 | Fiesta Restaurant Group Inc | Goldman Sachs | 269 | 22.046 | First Business Financial Services Inc | Goldman Sachs | 39.903 |
| 7.108 | Fiesta Restaurant Group Inc | HSBC | 1.102 | 14.181 | First Business Financial Services Inc | HSBC | 26.660 |
| 16.274 | Fiesta Restaurant Group Inc | Morgan Stanley | (814) | 726 | First Capital Inc | Bank of America Merrill Lynch | 577 |
| (28.327) | Fifth Third Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (14.660) | 218 | First Capital Inc | Barclays Bank | 73 |
| (36.569) | Fifth Third Bancorp | Barclays Bank | 17.672 | 186 | First Capital Inc | Morgan Stanley | 62 |
| (19.931) | Fifth Third Bancorp | HSBC | (10.763) | (1.017) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Barclays Bank | 45.531 |
| (39.738) | Fifth Third Bancorp | Morgan Stanley | 20.789 | (166) | First Citizens BancShares Inc 'A' | HSBC | (28.537) |
| (11.153) | Figs Inc 'A' | HSBC | (6.357) | (99) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.432 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (24.711) | First Commonwealth Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (9.989) | 16.877 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | HSBC | 9.669 |
| (12.837) | First Commonwealth Financial Corp | Barclays Bank | 2.576 | 4.540 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.677) |
| (5.922) | First Commonwealth Financial Corp | HSBC | (5.056) | (9.972) | First Merchants Corp | Barclays Bank | 1.596 |
| (9.983) | First Commonwealth Financial Corp | Morgan Stanley | 1.997 | (24.191) | First Mid Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (35.803) |
| 11.100 | First Community Bankshares Inc | Barclays Bank | 10.878 | (29.242) | First Mid Bancshares Inc | Goldman Sachs | (43.278) |
| 11.024 | First Community Bankshares Inc | Goldman Sachs | 33.954 | (12.827) | First Mid Bancshares Inc | Morgan Stanley | (4.233) |
| 36.486 | First Community Bankshares Inc | HSBC | 133.174 | 51.778 | First Northwest Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 50.484 |
| 3.137 | First Community Corp | Barclays Bank | 643 | 4.939 | First Northwest Bancorp | Barclays Bank | 3.680 |
| 12.834 | First Community Corp | Morgan Stanley | 2.631 | 9.608 | First Northwest Bancorp | Goldman Sachs | 9.368 |
| (1.320) | First Financial Bancorp | Barclays Bank | 581 | 10.821 | First of Long Island Corp | Barclays Bank | (1.731) |
| (52.236) | First Financial Bancorp | Goldman Sachs | (31.342) | 10.236 | First of Long Island Corp | Goldman Sachs | 6.449 |
| (10.464) | First Financial Bankshares Inc | Barclays Bank | 12.034 | 13.843 | First of Long Island Corp | HSBC | 6.229 |
| (30.260) | First Financial Bankshares Inc | Goldman Sachs | (13.012) | 17.845 | First of Long Island Corp | Morgan Stanley | (2.855) |
| (11.509) | First Financial Bankshares Inc | HSBC | 2.417 | 16.901 | First Savings Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 15.718 |
| 18.084 | First Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 7.853 | 1.916 | First Savings Financial Group Inc | Barclays Bank | (594) |
| 14.756 | First Financial Corp | Barclays Bank | (10.939) | 6.417 | First Savings Financial Group Inc | Goldman Sachs | 5.968 |
| 8.819 | First Financial Corp | Goldman Sachs | 3.969 | 776 | First Savings Financial Group Inc | HSBC | 31 |
| 6.417 | First Financial Corp | HSBC | 5.641 | (519) | First Solar Inc | Barclays Bank | 93 |
| 4.064 | First Financial Corp | Morgan Stanley | (2.967) | (2.257) | First Solar Inc | Goldman Sachs | 45.321 |
| 10.580 | First Financial Northwest Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.126 | (867) | First Solar Inc | Morgan Stanley | 156 |
| 33.075 | First Financial Northwest Inc | Goldman Sachs | 12.899 | 3.579 | First United Corp | Barclays Bank | 895 |
| 41.580 | First Foundation Inc | Barclays Bank | (16.216) | 20.001 | First United Corp | Goldman Sachs | 16.001 |
| (2.362) | First Guaranty Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.925) | 13.494 | First United Corp | Morgan Stanley | 3.374 |
| (2.425) | First Guaranty Bancshares Inc | Morgan Stanley | (497) | 7.394 | First Watch Restaurant Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.884 |
| 1.625 | First Hawaiian Inc | Bank of America Merrill Lynch | 569 | 14.272 | First Watch Restaurant Group Inc | Barclays Bank | (7.850) |
| (34.656) | First Hawaiian Inc | Barclays Bank | 25.299 | 6.188 | First Watch Restaurant Group Inc | Goldman Sachs | 2.413 |
| 4.917 | First Hawaiian Inc | Barclays Bank | (3.589) | 6.317 | First Watch Restaurant Group Inc | Morgan Stanley | (3.474) |
| (12.859) | First Hawaiian Inc | Goldman Sachs | (4.501) | 1.556 | First Western Financial Inc | Barclays Bank | (78) |
| 8.114 | First Hawaiian Inc | HSBC | (3.651) | 4.033 | First Western Financial Inc | Goldman Sachs | 6.856 |
| 11.074 | First Hawaiian Inc | Morgan Stanley | (8.084) | 6.352 | First Western Financial Inc | HSBC | 9.909 |
| (17.047) | First Horizon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6.989) | 5.913 | FirstCash Holdings Inc | Barclays Bank | (13.541) |
| (1.508) | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 694 | 823 | FirstCash Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.885) |
| 10.314 | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 2.785 | (18.789) | FirstEnergy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 33.257 |
| 51.594 | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (23.733) | (24.053) | FirstEnergy Corp | Barclays Bank | 20.445 |
| (1.778) | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 818 | (47.612) | FirstEnergy Corp | Goldman Sachs | 84.273 |
| (22.587) | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | 34.106 | (97.132) | FirstEnergy Corp | HSBC | 199.121 |
| 5.616 | First Internet Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 5.223 | (41.090) | FirstEnergy Corp | Morgan Stanley | 34.926 |
| 9.363 | First Internet Bancorp | Barclays Bank | 3.839 | (25.048) | Fiserv Inc | Barclays Bank | 212.907 |
| 8.440 | First Internet Bancorp | Goldman Sachs | 7.849 | (10.153) | Fiserv Inc | Goldman Sachs | 88.128 |
| 2.066 | First Internet Bancorp | HSBC | 3.568 | (4.754) | Fiserv Inc | HSBC | 40.219 |
| 13.441 | First Internet Bancorp | Morgan Stanley | 5.511 | (5.087) | Fiserv Inc | Morgan Stanley | 43.239 |
| 6.429 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.957 | 4.309 | Five Below Inc | Bank of America Merrill Lynch | (114.404) |
| 19.990 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Barclays Bank | (16.192) | 6.130 | Five Below Inc | Barclays Bank | (83.429) |
| 54.384 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Goldman Sachs | 19.969 | 3.458 | Five Below Inc | Goldman Sachs | (91.810) |
| | | | | 2.354 | Five Below Inc | HSBC | (57.179) |
| | | | | 4.222 | Five Below Inc | Morgan Stanley | (57.462) |
| | | | | (7.172) | Five Star Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (6.670) |
| | | | | (5.776) | Five Star Bancorp | Barclays Bank | 3.292 |
| | | | | (6.296) | Five Star Bancorp | HSBC | 378 |
| | | | | 8.529 | Five9 Inc | Barclays Bank | 2.047 |
| | | | | 1.287 | Five9 Inc | Goldman Sachs | 10.298 |
| | | | | 4.645 | Five9 Inc | HSBC | 39.853 |
| | | | | 3.451 | Five9 Inc | Morgan Stanley | 829 |
| | | | | (2.708) | FleetCor Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.749 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (4.298) | FleetCor Technologies Inc | Barclays Bank | 47.923 | 16.344 | FNB Corp | HSBC | 10.950 |
| (10.383) | FleetCor Technologies Inc | Goldman Sachs | 38.166 | 22.268 | FNB Corp | Morgan Stanley | (2.004) |
| (250) | FleetCor Technologies Inc | HSBC | 2.075 | (14.416) | Focus Financial Partners Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.730) |
| (2.125) | FleetCor Technologies Inc | Morgan Stanley | 23.694 | (4.200) | Focus Financial Partners Inc 'A' | Barclays Bank | (126) |
| 2.523 | FLEX LNG Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (4.594) | (887) | Focus Financial Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | (106) |
| 3.743 | FLEX LNG Ltd | Barclays Bank | (4.880) | (2.610) | Focus Financial Partners Inc 'A' | HSBC | (355) |
| 2.075 | FLEX LNG Ltd | Goldman Sachs | (4.980) | (2.995) | Focus Financial Partners Inc 'A' | Morgan Stanley | (90) |
| 4.307 | FLEX LNG Ltd | HSBC | (9.054) | (2.780) | Focus Universal Inc | HSBC | 1.056 |
| 2.797 | FLEX LNG Ltd | Morgan Stanley | (3.664) | 4.127 | Foghorn Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 124 |
| 127.668 | Flex Ltd | Barclays Bank | 131.498 | 13.572 | Foghorn Therapeutics Inc | HSBC | 14.251 |
| 12.658 | Flex Ltd | HSBC | 59.619 | 3.554 | FONAR Corp | Goldman Sachs | 1.990 |
| 9.636 | Flexion Therapeutics* | Morgan Stanley | 8.094 | 1.523 | FONAR Corp | Morgan Stanley | (228) |
| (6.217) | Flexsteel Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (12.123) | 4.544 | Foot Locker Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.548) |
| (11.802) | Flexsteel Industries Inc | Barclays Bank | (11.566) | 3.200 | Foot Locker Inc | Barclays Bank | (6.272) |
| (1.067) | Flexsteel Industries Inc | Goldman Sachs | (2.081) | 593 | Foot Locker Inc | Goldman Sachs | (8.498) |
| (1.163) | Flexsteel Industries Inc | HSBC | (2.675) | 17.797 | Foot Locker Inc | HSBC | (251.215) |
| (4.464) | Flexsteel Industries Inc | Morgan Stanley | (4.375) | 24.293 | Ford Motor Co | Bank of America Merrill Lynch | 14.809 |
| (535) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (568) | 48.381 | Ford Motor Co | Barclays Bank | 32.746 |
| (22.865) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (42.789) | 20.000 | Ford Motor Co | Goldman Sachs | 14.995 |
| (6.844) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.505) | 32.276 | Ford Motor Co | HSBC | 17.552 |
| (7.033) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | HSBC | (2.673) | 9.352 | Ford Motor Co | Morgan Stanley | 5.892 |
| (1.366) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.541) | (19.521) | Forestar Group Inc | Barclays Bank | 6.247 |
| (76.369) | Flotek Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.062) | (18.254) | Forestar Group Inc | Goldman Sachs | (730) |
| (11.910) | Flotek Industries Inc | Goldman Sachs | (322) | 3.304 | FormFactor Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.930 |
| (38.629) | Flotek Industries Inc | HSBC | (1.468) | 13.210 | FormFactor Inc | Goldman Sachs | 31.704 |
| (72.024) | Flotek Industries Inc | Morgan Stanley | 1.952 | 9.181 | FormFactor Inc | HSBC | 30.756 |
| (31.780) | Flowers Foods Inc | Barclays Bank | 13.348 | 6.875 | Forrester Research Inc | Barclays Bank | 4.950 |
| 19.336 | Flowers Foods Inc | Barclays Bank | (8.121) | 20.042 | Forte Biosciences Inc | Goldman Sachs | (1.302) |
| (39.812) | Flowers Foods Inc | Goldman Sachs | 134.166 | 10.729 | Forte Biosciences Inc | HSBC | (482) |
| (34.879) | Flowers Foods Inc | Morgan Stanley | 19.730 | 1.964 | Fortinet Inc | Bank of America Merrill Lynch | 750 |
| 19.404 | Flowers Foods Inc | Morgan Stanley | (8.150) | 333 | Fortinet Inc | Barclays Bank | (290) |
| 1.322 | Flowserve Corp | Barclays Bank | (426) | 23.094 | Fortinet Inc | Goldman Sachs | 2.235 |
| (3.778) | Flowserve Corp | Goldman Sachs | 7.254 | 3.683 | Fortinet Inc | HSBC | 2.341 |
| 1.586 | Flowserve Corp | Goldman Sachs | (1.062) | 4.191 | Fortinet Inc | Morgan Stanley | (3.646) |
| 8.054 | Flowserve Corp | Morgan Stanley | (14.336) | 8.597 | Fortitude Gold Corp | Barclays Bank | (1.706) |
| (3.850) | Fluence Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.463 | 19.016 | Fortitude Gold Corp | Morgan Stanley | (3.775) |
| (22.108) | Fluence Energy Inc | Barclays Bank | (34.268) | (57.171) | Fortive Corp | Goldman Sachs | (21.725) |
| (1.288) | Fluence Energy Inc | Morgan Stanley | (1.996) | 8.792 | Fortive Corp | HSBC | 10.990 |
| 1.895 | Fluor Corp | Bank of America Merrill Lynch | 577 | (3.443) | Fortive Corp | Morgan Stanley | 1.274 |
| 18.701 | Fluor Corp | Barclays Bank | (15.883) | 6.142 | Fortive Corp | Morgan Stanley | (2.273) |
| 8.582 | Fluor Corp | Goldman Sachs | 170 | (83.042) | Fortress Biotech Inc | Barclays Bank | (8) |
| 8.636 | Fluor Corp | HSBC | (1.381) | (4.679) | Fortune Brands Innovations Inc | Bank of America Merrill Lynch | 23.208 |
| 38.886 | Fluor Corp | Morgan Stanley | (33.881) | (63.478) | Fortune Brands Innovations Inc | Barclays Bank | 243.121 |
| (5.483) | Flushing Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (11.185) | (21.170) | Fortune Brands Innovations Inc | Goldman Sachs | 105.003 |
| (14.341) | Flushing Financial Corp | Barclays Bank | (3.585) | (23.213) | Fortune Brands Innovations Inc | HSBC | 119.315 |
| (15.040) | Flushing Financial Corp | HSBC | (24.816) | 4.488 | Forum Energy Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (718) |
| (2.696) | Flushing Financial Corp | Morgan Stanley | (674) | 1.465 | Forum Energy Technologies Inc | Barclays Bank | (3.531) |
| (5.836) | Flywire Corp | Bank of America Merrill Lynch | 11.030 | 3.123 | Forum Energy Technologies Inc | Goldman Sachs | (500) |
| (3.318) | FMC Corp | Barclays Bank | 13.490 | 2.467 | Forum Energy Technologies Inc | Morgan Stanley | (5.945) |
| (223) | FMC Corp | Goldman Sachs | 1.474 | (6.389) | Forward Air Corp | Barclays Bank | 12.970 |
| 7.198 | FMC Corp | HSBC | (60.535) | (2.126) | Forward Air Corp | Goldman Sachs | 617 |
| (1.910) | FMC Corp | HSBC | 16.063 | (6.502) | Forward Air Corp | HSBC | 2.601 |
| 5.999 | FMC Corp | Morgan Stanley | (25.676) | (1.765) | Forward Air Corp | Morgan Stanley | 3.583 |
| (1.076) | FMC Corp | Morgan Stanley | 2.867 | | | | |
| 18.832 | FNB Corp | Bank of America Merrill Lynch | 12.052 | | | | |
| 33.425 | FNB Corp | Barclays Bank | (3.009) | | | | |
| 10.306 | FNB Corp | Goldman Sachs | 6.596 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 15.470 | Fossil Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (851) | (4.051) | Freshpet Inc | Bank of America Merrill Lynch | 31.558 |
| 4.038 | Fossil Group Inc | Barclays Bank | (20) | (4.668) | Freshpet Inc | Barclays Bank | 20.446 |
| 26.538 | Fossil Group Inc | Goldman Sachs | (1.460) | (3.937) | Freshpet Inc | Goldman Sachs | 30.669 |
| 13.964 | Fossil Group Inc | Morgan Stanley | (70) | (1.702) | Freshpet Inc | HSBC | 10.076 |
| (2.242) | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 807 | (544) | Freshpet Inc | Morgan Stanley | 2.383 |
| (44.182) | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 11.046 | (23.392) | Freshworks Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (8.535) |
| (21.594) | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 7.774 | (2.956) | Freshworks Inc 'A' | Barclays Bank | 1.537 |
| (14.991) | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 3.748 | (27.461) | Freshworks Inc 'A' | HSBC | (15.859) |
| 9.101 | Fox Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 3.185 | (28.892) | Freshworks Inc 'A' | Morgan Stanley | 13.823 |
| 60.890 | Fox Corp 'A' | Barclays Bank | 3.045 | 17.538 | Frontdoor Inc | Barclays Bank | 351 |
| 129.981 | Fox Corp 'A' | Goldman Sachs | 45.493 | 6.582 | Frontdoor Inc | Goldman Sachs | (5.964) |
| 1.108 | Fox Corp 'A' | HSBC | (897) | 24.606 | Frontdoor Inc | HSBC | 11.565 |
| 48.493 | Fox Corp 'A' | Morgan Stanley | 2.424 | 3.320 | Frontdoor Inc | Morgan Stanley | 66 |
| (4.331) | Fox Factory Holding Corp | Barclays Bank | 36.640 | (2.149) | Frontier Communications Parent Inc | Bank of America Merrill Lynch | 922 |
| (9.766) | Fox Factory Holding Corp | HSBC | 67.581 | (32.345) | Frontier Communications Parent Inc | Barclays Bank | 22.642 |
| (5.411) | Fox Factory Holding Corp | Morgan Stanley | 45.777 | (54.211) | Frontier Communications Parent Inc | Goldman Sachs | 158.296 |
| (22.152) | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (12.848) | (24.346) | Frontier Communications Parent Inc | Morgan Stanley | 17.042 |
| (31.809) | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 1.272 | (3.007) | Frontier Group Holdings Inc | Barclays Bank | (1.113) |
| (5.890) | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.416) | (5.348) | Frontier Group Holdings Inc | HSBC | (1.016) |
| (13.588) | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | (10.327) | (29.952) | Frontier Group Holdings Inc | Morgan Stanley | (11.082) |
| (1.484) | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 59 | (7.928) | Frontline Plc | Barclays Bank | 3.647 |
| 6.363 | Franklin Covey Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.336 | (1.154) | Frontline Plc | Goldman Sachs | 866 |
| 1.194 | Franklin Covey Co | Barclays Bank | (752) | (1.447) | Frontline Plc | HSBC | 521 |
| 17.853 | Franklin Covey Co | Goldman Sachs | 3.749 | (22.732) | Frontline Plc | Morgan Stanley | 10.457 |
| 5.631 | Franklin Covey Co | HSBC | 7.095 | 2.194 | FRP Holdings Inc | Goldman Sachs | (220) |
| 2.791 | Franklin Covey Co | Morgan Stanley | (1.758) | 7.554 | FS Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 906 |
| 4.814 | Franklin Electric Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 913 | 28.414 | FS Bancorp Inc | Barclays Bank | (3.126) |
| 29.435 | Franklin Electric Co Inc | Barclays Bank | (42.092) | 2.855 | FS Bancorp Inc | Goldman Sachs | 343 |
| 2.823 | Franklin Electric Co Inc | Goldman Sachs | 508 | 16.202 | FS Bancorp Inc | HSBC | (12.152) |
| 2.784 | Franklin Electric Co Inc | HSBC | (2.812) | 17.285 | FS Bancorp Inc | Morgan Stanley | (1.901) |
| 5.590 | Franklin Electric Co Inc | Morgan Stanley | (7.994) | 532 | F-star Therapeutics Inc' | Goldman Sachs | 213 |
| 6.567 | Franklin Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.824) | 532 | F-star Therapeutics Inc' | Goldman Sachs | 213 |
| 8.842 | Franklin Resources Inc | Barclays Bank | (4.686) | (6.059) | FTC Solar Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.423 |
| 44.956 | Franklin Resources Inc | HSBC | (57.544) | (74.822) | FTC Solar Inc | Barclays Bank | 40.778 |
| 8.765 | Franklin Resources Inc | Morgan Stanley | (4.645) | (13.195) | FTC Solar Inc | Morgan Stanley | 7.191 |
| (50.087) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (250) | (663) | FTI Consulting Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9.236) |
| (42.859) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | Barclays Bank | 3.643 | (2.112) | FTI Consulting Inc | Barclays Bank | (10.771) |
| (42.887) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | Goldman Sachs | (214) | (2.844) | FTI Consulting Inc | Goldman Sachs | (27.240) |
| (82.517) | Franklin Street Properties Corp (REIT) | HSBC | (17.741) | (308) | FTI Consulting Inc | HSBC | 554 |
| (31.785) | Freeport-McMoRan Inc | Goldman Sachs | 82.005 | (464) | FTI Consulting Inc | Morgan Stanley | (2.366) |
| 6.351 | Freeport-McMoRan Inc | Goldman Sachs | (14.807) | 30.796 | fuboTV Inc | Barclays Bank | (7.545) |
| 2.285 | Freeport-McMoRan Inc | HSBC | (5.101) | 12.998 | fuboTV Inc | Morgan Stanley | (3.185) |
| (11.542) | FreightCar America Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.847 | (94.246) | FuelCell Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 26.860 |
| 10.595 | Fresh Del Monte Produce Inc | Barclays Bank | (2.330) | (169.657) | FuelCell Energy Inc | HSBC | 44.959 |
| 3.887 | Fresh Del Monte Produce Inc | Goldman Sachs | (844) | (19.546) | Fulcrum Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 16.028 |
| 19.508 | Fresh Del Monte Produce Inc | HSBC | (22.434) | (9.336) | Fulcrum Therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.334 |
| 824 | Fresh Del Monte Produce Inc | Morgan Stanley | (179) | (19.049) | Fulcrum Therapeutics Inc | HSBC | 4.953 |
| | | | | 10.420 | Fulgent Genetics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 29.280 |
| | | | | 1.877 | Fulgent Genetics Inc | Barclays Bank | (1.558) |
| | | | | 831 | Fulgent Genetics Inc | HSBC | 5.127 |
| | | | | (12.242) | Full House Resorts Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.530) |
| | | | | (11.834) | Full House Resorts Inc | Barclays Bank | 7.100 |
| | | | | (43.504) | Full House Resorts Inc | Goldman Sachs | (16.096) |
| | | | | (15.575) | Full House Resorts Inc | HSBC | (14.173) |
| | | | | (2.622) | Full House Resorts Inc | Morgan Stanley | 1.573 |
| | | | | 72.281 | Fulton Financial Corp | HSBC | 76.618 |
| | | | | (15.356) | Funko Inc 'A' | Barclays Bank | 4.300 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|----------------------------------|---|---|------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (24.506) | Funko Inc 'A' | Goldman Sachs | (18.134) | 5.700 | GCM Grosvenor Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.539) |
| (1.816) | FutureFuel Corp | Bank of America Merrill Lynch | 662 | (35.506) | GE Healthcare Inc | Barclays Bank | 2.486 |
| (32.625) | FutureFuel Corp | Barclays Bank | 17.617 | (6.522) | GE Healthcare Inc | Goldman Sachs | (26.610) |
| (5.626) | FutureFuel Corp | Goldman Sachs | 1.407 | (571) | GE Healthcare Inc | HSBC | 234 |
| (11.408) | FVCBankcorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16.142) | 1.670 | Gen Digital Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.285 |
| (20.151) | FVCBankcorp Inc | Barclays Bank | (4.534) | 12.895 | Gen Digital Inc | Barclays Bank | 4.836 |
| (2.003) | FVCBankcorp Inc | Goldman Sachs | (2.834) | 3.696 | Gen Digital Inc | HSBC | 4.475 |
| (35.818) | FVCBankcorp Inc | HSBC | (59.279) | 5.745 | Gen Digital Inc | Morgan Stanley | 2.154 |
| 6.302 | G1 Therapeutics Inc | Barclays Bank | (1.512) | (60.317) | Genasys Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.635) |
| 2.368 | Gaia Inc | Bank of America Merrill Lynch | (995) | (16.015) | Genasys Inc | Barclays Bank | 5.605 |
| 18.639 | Gaia Inc | Goldman Sachs | (7.828) | (6.728) | Genasys Inc | Goldman Sachs | (740) |
| 712 | Gaia Inc | HSBC | (342) | (18.950) | Genasys Inc | HSBC | 3.601 |
| 1.444 | Gaia Inc | Morgan Stanley | (202) | (5.637) | Genasys Inc | Morgan Stanley | 1.973 |
| 5.836 | Gambling.com Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.459 | (13.807) | Genco Shipping & Trading Ltd | Goldman Sachs | 18.225 |
| 11.609 | Gambling.com Group Ltd | Barclays Bank | — | (13.665) | Genco Shipping & Trading Ltd | HSBC | 18.721 |
| 6.987 | Gambling.com Group Ltd | Goldman Sachs | 1.747 | 8.103 | Gencor Industries Inc | Barclays Bank | (2.147) |
| 11.928 | Gambling.com Group Ltd | HSBC | 1.670 | 15.818 | Gencor Industries Inc | Goldman Sachs | (14.790) |
| 7.770 | Gambling.com Group Ltd | Morgan Stanley | — | 4.148 | Gencor Industries Inc | HSBC | 62 |
| (1.311) | GameStop Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (3.972) | (844) | Generac Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 821 |
| (16.109) | GameStop Corp 'A' | Barclays Bank | (7.088) | (2.061) | Generac Holdings Inc | Barclays Bank | 14.262 |
| (4.463) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 5.735 | (461) | Generac Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.286 |
| (25.953) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 26.862 | (5.357) | Generac Holdings Inc | HSBC | (4.768) |
| (31.819) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 40.887 | (3.015) | Generac Holdings Inc | Morgan Stanley | 20.864 |
| (11.726) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | HSBC | 46.259 | 650 | Generac Holdings Inc | Morgan Stanley | (4.498) |
| (11.575) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 11.980 | (4.238) | General Electric Co | Barclays Bank | 16.232 |
| (6.059) | GAN Ltd | Barclays Bank | 848 | (843) | General Electric Co | Goldman Sachs | 1.079 |
| (22.888) | GAN Ltd | Goldman Sachs | 458 | (2.003) | General Electric Co | HSBC | 401 |
| (37.494) | Gannett Co Inc | Goldman Sachs | (7.124) | (1.787) | General Electric Co | Morgan Stanley | 6.844 |
| (45.214) | Gannett Co Inc | HSBC | (12.660) | 9.752 | General Mills Inc | Bank of America Merrill Lynch | (56.831) |
| 92.712 | Gap Inc | Bank of America Merrill Lynch | 22.095 | 19.578 | General Mills Inc | Barclays Bank | (43.532) |
| 94.900 | Gap Inc | Barclays Bank | 18.980 | 14.933 | General Mills Inc | HSBC | (96.339) |
| 13.113 | Gap Inc | Goldman Sachs | 2.885 | 23.187 | General Mills Inc | Morgan Stanley | (53.099) |
| 24.906 | Gap Inc | HSBC | (7.472) | 16.743 | General Motors Co | Bank of America Merrill Lynch | 4.018 |
| 37.886 | Gap Inc | Morgan Stanley | 7.577 | 28.505 | General Motors Co | Barclays Bank | (7.126) |
| 3.339 | Garmin Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.541 | (7.658) | General Motors Co | Barclays Bank | 1.915 |
| 22.818 | Garmin Ltd | Goldman Sachs | 31.032 | 35.069 | General Motors Co | Goldman Sachs | 8.417 |
| 3.655 | Garmin Ltd | HSBC | 5.921 | 25.318 | General Motors Co | HSBC | (26.584) |
| 12.070 | Garmin Ltd | Morgan Stanley | 4.345 | 17.037 | General Motors Co | Morgan Stanley | (4.259) |
| 3.991 | Gartner Inc | Barclays Bank | 51.723 | (2.004) | General Motors Co | Morgan Stanley | 501 |
| 4.344 | Gartner Inc | HSBC | 174.541 | 5.718 | Generation Bio Co | Barclays Bank | (2.402) |
| 3.148 | Gates Industrial Corp Plc | Bank of America Merrill Lynch | 532 | 8.880 | Generation Bio Co | Goldman Sachs | (8.170) |
| (60.437) | Gates Industrial Corp Plc | Barclays Bank | 8.461 | 8.911 | Generation Bio Co | Morgan Stanley | (3.743) |
| (53.568) | Gates Industrial Corp Plc | Goldman Sachs | 104.458 | 464 | Genesco Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.881) |
| 2.766 | Gates Industrial Corp Plc | Goldman Sachs | 799 | 2.430 | Genesco Inc | Barclays Bank | (23.425) |
| (23.361) | Gates Industrial Corp Plc | HSBC | 53.497 | 1.961 | Genesco Inc | Goldman Sachs | (20.630) |
| 3.423 | Gates Industrial Corp Plc | Morgan Stanley | 578 | 2.807 | Genesco Inc | HSBC | (32.028) |
| (22.498) | Gatos Silver Inc | Barclays Bank | 12.374 | 566 | Genesco Inc | Morgan Stanley | (5.456) |
| (23.955) | Gatos Silver Inc | HSBC | 38.807 | (2.562) | Genie Energy Ltd 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 5.098 |
| 1.242 | GATX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 10.368 | (18.827) | Genie Energy Ltd 'B' | Goldman Sachs | 37.466 |
| 13.800 | GATX Corp | Barclays Bank | 91.908 | 8.044 | Genpact Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (5.364) |
| 7.365 | GATX Corp | Goldman Sachs | 71.239 | 12.583 | Genpact Ltd | Barclays Bank | (16.861) |
| 7.233 | GATX Corp | HSBC | 58.555 | 9.077 | Genpact Ltd | Goldman Sachs | (2.814) |
| 6.780 | GATX Corp | Morgan Stanley | 43.577 | 3.434 | Genpact Ltd | HSBC | (8.708) |
| 60.936 | GCM Grosvenor Inc 'A' | Barclays Bank | (16.453) | 10.338 | Genpact Ltd | Morgan Stanley | (13.853) |
| 39.501 | GCM Grosvenor Inc 'A' | Goldman Sachs | (790) | (28.117) | Genpact Ltd | Barclays Bank | 46.393 |
| 42.901 | GCM Grosvenor Inc 'A' | HSBC | (35.608) | (28.877) | Genpact Ltd | Goldman Sachs | 63.818 |
| | | | | (45.716) | Genpact Ltd | HSBC | 122.519 |
| | | | | 348 | Gentherm Inc | Bank of America Merrill Lynch | (856) |
| | | | | 6.533 | Gentherm Inc | Barclays Bank | (26.001) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 500 | Gentherm Inc | Goldman Sachs | (1.259) | 7.268 | Gladstone Land Corp | | |
| 406 | Gentherm Inc | HSBC | (1.270) | | (REIT) | Goldman Sachs | 2.544 |
| 4.008 | Gentherm Inc | Morgan Stanley | (15.952) | 5.424 | Gladstone Land Corp | | |
| (16.756) | Genworth Financial Inc 'A' | HSBC | (4.357) | | (REIT) | HSBC | (271) |
| (4.195) | Genworth Financial Inc 'A' | Morgan Stanley | — | 2.640 | Gladstone Land Corp | | |
| (7.591) | GEO Group Inc | Barclays Bank | 7.136 | | (REIT) | Morgan Stanley | 871 |
| (7.107) | Geospace Technologies Corp | Bank of America | | (43.574) | Glatfelter Corp | Barclays Bank | 32.245 |
| | | Merrill Lynch | 284 | (19.440) | Glatfelter Corp | Goldman Sachs | 11.275 |
| (10.773) | Geospace Technologies Corp | Barclays Bank | 431 | (1.310) | Glaukos Corp | HSBC | (9.183) |
| (16.314) | Geospace Technologies Corp | Goldman Sachs | 653 | 8.210 | Global Industrial Co | Bank of America | |
| (7.864) | Geospace Technologies Corp | Morgan Stanley | 315 | | (REIT) | Merrill Lynch | 10.837 |
| (19.395) | German American Bancorp Inc | Barclays Bank | (4.655) | 1.504 | Global Industrial Co | Barclays Bank | (75) |
| (15.485) | German American Bancorp Inc | Goldman Sachs | (20.905) | 2.088 | Global Industrial Co | Goldman Sachs | 2.756 |
| (17.807) | German American Bancorp Inc | HSBC | (13.889) | 23.862 | Global Industrial Co | HSBC | 40.327 |
| (171.005) | Geron Corp | Barclays Bank | (33.346) | 16.767 | Global Industrial Co | Morgan Stanley | (838) |
| (6.419) | Getty Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (2.311) | (15.125) | Global Medical Inc (REIT) | Bank of America | |
| (11.420) | Getty Realty Corp (REIT) | HSBC | 2.969 | | (REIT) | Merrill Lynch | 2.996 |
| (213.266) | Gevo Inc | Barclays Bank | (11.730) | (43.081) | Global Medical Inc (REIT) | Barclays Bank | 603 |
| (22.352) | Gevo Inc | Goldman Sachs | (1.900) | (56.600) | Global Medical Inc (REIT) | Goldman Sachs | 13.018 |
| (28.120) | Gevo Inc | HSBC | (2.390) | (59.852) | Global Medical Inc (REIT) | HSBC | 17.956 |
| (67.099) | Gevo Inc | Morgan Stanley | (3.690) | (34.665) | Global Medical Inc (REIT) | Morgan Stanley | 347 |
| 9.964 | Gibraltar Industries Inc | Bank of America | | 1.530 | Global Payments Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (14.547) | | | Merrill Lynch | (3.534) |
| 13.943 | Gibraltar Industries Inc | Barclays Bank | (45.315) | 3.192 | Global Payments Inc | Barclays Bank | (20.429) |
| 6.358 | Gibraltar Industries Inc | Goldman Sachs | (9.283) | 2.272 | Global Payments Inc | HSBC | (10.177) |
| 6.506 | Gibraltar Industries Inc | HSBC | 1.822 | 4.626 | Global Payments Inc | Morgan Stanley | (27.218) |
| 7.673 | Gibraltar Industries Inc | Morgan Stanley | (24.937) | 12.798 | Global Water Resources Inc | Barclays Bank | (4.479) |
| (14.655) | G-III Apparel Group Ltd | Barclays Bank | 7.621 | 25.004 | Global Water Resources Inc | Goldman Sachs | 5.251 |
| (7.662) | G-III Apparel Group Ltd | Goldman Sachs | 3.295 | 14.225 | Global Water Resources Inc | Morgan Stanley | (4.979) |
| (14.217) | G-III Apparel Group Ltd | HSBC | (427) | (3.015) | GLOBALFOUNDRIES Inc | Barclays Bank | (6.573) |
| 6.442 | Gilead Sciences Inc | Bank of America | | (1.002) | GLOBALFOUNDRIES Inc | Morgan Stanley | (2.184) |
| | | Merrill Lynch | (11.724) | (62.626) | Globalstar Inc | Barclays Bank | 1.879 |
| (2.348) | Gilead Sciences Inc | Bank of America | | (119.380) | Globalstar Inc | Goldman Sachs | (13.132) |
| | | Merrill Lynch | 4.273 | 122 | Globant SA | Barclays Bank | 1.324 |
| 1.689 | Gilead Sciences Inc | Barclays Bank | (3.479) | 2.034 | Globant SA | Morgan Stanley | 22.069 |
| 1.235 | Gilead Sciences Inc | Goldman Sachs | (2.248) | 3.611 | Globe Life Inc | Bank of America | |
| 2.174 | Gilead Sciences Inc | HSBC | (4.413) | | | Merrill Lynch | (12.068) |
| 6.237 | Gilead Sciences Inc | Morgan Stanley | (12.848) | (5.242) | Globe Life Inc | Barclays Bank | 21.859 |
| 111.103 | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | Bank of America | | 357 | Globe Life Inc | Barclays Bank | (1.489) |
| | | Merrill Lynch | 37.775 | (7.062) | Globe Life Inc | Goldman Sachs | 23.799 |
| 96.403 | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | Barclays Bank | 14.460 | 3.104 | Globe Life Inc | HSBC | (12.664) |
| 142.827 | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | Goldman Sachs | 48.561 | 3.625 | Globe Life Inc | Morgan Stanley | (15.116) |
| 149.308 | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | HSBC | 43.299 | (894) | Globus Medical Inc 'A' | Bank of America | |
| 91.722 | Ginkgo Bioworks Holdings Inc | Morgan Stanley | 13.758 | | | Merrill Lynch | 2.345 |
| (2.177) | Gitlab Inc 'A' | Bank of America | | (2.291) | Globus Medical Inc 'A' | Morgan Stanley | 10.951 |
| | | Merrill Lynch | (11.625) | 10.414 | Globus Medical Inc 'A' | Morgan Stanley | (49.779) |
| (4.000) | Gitlab Inc 'A' | Barclays Bank | (5.760) | (8.222) | GlycoMimetics Inc | Bank of America | |
| (3.581) | Gitlab Inc 'A' | HSBC | (20.949) | | | Merrill Lynch | 2.631 |
| (19.516) | Glacier Bancorp Inc | Barclays Bank | 20.492 | (41.975) | GlycoMimetics Inc | HSBC | (11.753) |
| (83.578) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Barclays Bank | 7.522 | (7.286) | GMS Inc | Barclays Bank | (1.967) |
| (57.793) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Goldman Sachs | (17.338) | (8.287) | GMS Inc | Morgan Stanley | (2.237) |
| (13.475) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | HSBC | (674) | 3.580 | GoDaddy Inc 'A' | Bank of America | |
| 19.764 | Gladstone Land Corp (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 3.141 |
| | | Merrill Lynch | 6.917 | 5.854 | GoDaddy Inc 'A' | Barclays Bank | 1.862 |
| 12.516 | Gladstone Land Corp (REIT) | Barclays Bank | 4.130 | 4.643 | GoDaddy Inc 'A' | Goldman Sachs | 5.313 |
| | | | | 17.011 | GoDaddy Inc 'A' | HSBC | 48.215 |
| | | | | 7.964 | GoDaddy Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.150 |
| | | | | (1.942) | Gogo Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (150) |
| | | | | (7.847) | Gogo Inc | Barclays Bank | (2.647) |
| | | | | (13.563) | Gogo Inc | HSBC | (39.333) |
| | | | | (14.901) | Gogo Inc | Morgan Stanley | (5.513) |
| | | | | 3.646 | GoHealth Inc 'A' | Barclays Bank | (6.800) |
| | | | | 4.394 | GoHealth Inc 'A' | Goldman Sachs | 15.752 |
| | | | | 4.261 | GoHealth Inc 'A' | HSBC | 21.284 |
| | | | | 1.935 | GoHealth Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.609) |
| | | | | (13.082) | Golar LNG Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 20.539 |
| | | | | (11.936) | Golar LNG Ltd | Barclays Bank | 14.323 |
| | | | | (1.054) | Golar LNG Ltd | Goldman Sachs | 1.655 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (19.999) | Golar LNG Ltd | HSBC | 15.399 | (5.194) | Granite Ridge Resources Inc | Barclays Bank | 1.411 |
| (2.762) | Golar LNG Ltd | Morgan Stanley | 3.314 | 2.202 | Graphic Packaging Holding Co | Bank of America | (3.898) |
| 25.768 | Gold Resource Corp | Barclays Bank | (2.061) | (8.433) | Graphic Packaging Holding Co | Barclays Bank | 13.408 |
| 43.646 | Gold Resource Corp | Goldman Sachs | (3.928) | 1.012 | Graphic Packaging Holding Co | Goldman Sachs | (1.791) |
| 21.223 | Gold Resource Corp | HSBC | (3.820) | (11.322) | Graphic Packaging Holding Co | Goldman Sachs | 20.040 |
| 64.232 | Gold Resource Corp | Morgan Stanley | (5.139) | 40.667 | Graphic Packaging Holding Co | HSBC | (76.047) |
| 6.082 | Golden Entertainment Inc | Barclays Bank | (2.372) | (1.041) | Graphic Packaging Holding Co | HSBC | 1.947 |
| 2.328 | Golden Ocean Group Ltd | Bank of America | | 3.716 | Gray Television Inc | Bank of America | (1.375) |
| | | Merrill Lynch | (3.422) | 17.969 | Gray Television Inc | Barclays Bank | (12.399) |
| 2.137 | Golden Ocean Group Ltd | Barclays Bank | (2.137) | 34.620 | Gray Television Inc | Goldman Sachs | (12.809) |
| 5.085 | Golden Ocean Group Ltd | Goldman Sachs | (7.475) | 2.861 | Gray Television Inc | HSBC | 9 |
| 22.881 | Golden Ocean Group Ltd | HSBC | (35.694) | 38.208 | Gray Television Inc | Morgan Stanley | (26.364) |
| 10.105 | Golden Ocean Group Ltd | Morgan Stanley | (6.269) | (43.738) | Great Lakes Dredge & Dock Corp | Barclays Bank | 37.177 |
| (1.030) | Goldman Sachs Group Inc | Bank of America | | (5.300) | Great Southern Bancorp Inc | Goldman Sachs | (3.551) |
| | | Merrill Lynch | (2.441) | (4.895) | Green Brick Partners Inc | Barclays Bank | 17.132 |
| (2.304) | Goldman Sachs Group Inc | Barclays Bank | 733 | (4.315) | Green Brick Partners Inc | Goldman Sachs | 9.666 |
| (4.023) | Goldman Sachs Group Inc | HSBC | 12.564 | (1.522) | Green Plains Inc | Morgan Stanley | 2.104 |
| (2.384) | Goldman Sachs Group Inc | Morgan Stanley | 1.144 | (8.127) | Greenbrier Cos Inc | Barclays Bank | 4.728 |
| (12.167) | Goodyear Tire & Rubber Co | Barclays Bank | 3.042 | (7.441) | Greenbrier Cos Inc | Goldman Sachs | (5.506) |
| (19.018) | Goodyear Tire & Rubber Co | Goldman Sachs | 20.730 | (3.582) | Greenbrier Cos Inc | HSBC | (1.053) |
| 3.862 | Goodyear Tire & Rubber Co | Goldman Sachs | (4.210) | (3.291) | Greenbrier Cos Inc | Morgan Stanley | 1.964 |
| (8.670) | Goodyear Tire & Rubber Co | HSBC | (20.895) | (4.794) | Greene County Bancorp Inc | Bank of America | (38.448) |
| (4.058) | Goosehead Insurance Inc 'A' | Barclays Bank | 10.348 | (1.856) | Greene County Bancorp Inc | Barclays Bank | (8.500) |
| 2.582 | Goosehead Insurance Inc 'A' | Barclays Bank | (6.584) | (350) | Greene County Bancorp Inc | Goldman Sachs | (2.807) |
| (617) | Goosehead Insurance Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.530 | (176) | Greene County Bancorp Inc | HSBC | (1.570) |
| 13.125 | GoPro Inc 'A' | Bank of America | | 11.008 | Greenhill & Co Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.231 | 2.168 | Greenhill & Co Inc | Merrill Lynch | 84.101 |
| 56.901 | GoPro Inc 'A' | Barclays Bank | (569) | 5.518 | Greenhill & Co Inc | Barclays Bank | (347) |
| 45.525 | GoPro Inc 'A' | Goldman Sachs | 7.739 | 3.375 | Greenhill & Co Inc | Goldman Sachs | 42.158 |
| 13.656 | GoPro Inc 'A' | HSBC | (1.639) | (108.315) | Greenlight Capital Re Ltd 'A' | Morgan Stanley | (540) |
| 6.714 | GoPro Inc 'A' | Morgan Stanley | (67) | (58.246) | Greenlight Capital Re Ltd 'A' | Barclays Bank | 30.328 |
| (7.884) | Gorman-Rupp Co | Barclays Bank | 12.139 | 7.904 | Greif Inc 'A' | HSBC | 30.870 |
| (9.758) | Gorman-Rupp Co | Goldman Sachs | 4.684 | 3.266 | Greif Inc 'A' | Goldman Sachs | (11.594) |
| (26) | Gorman-Rupp Co | Morgan Stanley | 44 | 2.551 | Greif Inc 'A' | HSBC | (8.848) |
| (26.234) | Gossamer Bio Inc | Goldman Sachs | (1.574) | 839 | Greif Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.270) |
| (131.095) | Gossamer Bio Inc | Morgan Stanley | 27.530 | (2.455) | Greif Inc 'B' | Bank of America | |
| 14.181 | Graco Inc | Bank of America | | (8.851) | Greif Inc 'B' | Merrill Lynch | 13.723 |
| | | Merrill Lynch | (14.039) | (1.817) | Greif Inc 'B' | Barclays Bank | 27.792 |
| 21.978 | Graco Inc | Barclays Bank | (61.278) | (1.817) | Greif Inc 'B' | Goldman Sachs | 10.157 |
| 21.370 | Graco Inc | HSBC | (46.159) | (3.909) | Greif Inc 'B' | HSBC | 27.754 |
| 41.679 | Graco Inc | Morgan Stanley | (117.118) | (2.042) | Greif Inc 'B' | Morgan Stanley | 6.412 |
| (10.915) | GrafTech International Ltd | Bank of America | | 7.002 | Grid Dynamics Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | — | 7.598 | Grid Dynamics Holdings Inc | Merrill Lynch | 5.742 |
| (40.129) | GrafTech International Ltd | Barclays Bank | 8.428 | 10.518 | Grid Dynamics Holdings Inc | Barclays Bank | 2.431 |
| (37.582) | GrafTech International Ltd | Goldman Sachs | — | (1.704) | Griffon Corp | Morgan Stanley | 3.366 |
| (104.688) | GrafTech International Ltd | HSBC | (13.304) | (7.496) | Griffon Corp | Barclays Bank | 733 |
| (53.184) | GrafTech International Ltd | Morgan Stanley | 8.836 | (4.318) | Griffon Corp | Goldman Sachs | (4.797) |
| (5.986) | Graham Corp | Bank of America | | (2.692) | Griffon Corp | HSBC | (8.031) |
| | | Merrill Lynch | 120 | 21.161 | Gritstone bio Inc | Morgan Stanley | 733 |
| (7.047) | Graham Corp | Barclays Bank | 3.664 | 10.418 | Gritstone bio Inc | Barclays Bank | (2.539) |
| (137) | Graham Holdings Co 'B' | Bank of America | | 1.803 | Gritstone bio Inc | Goldman Sachs | (2.344) |
| | | Merrill Lynch | 2.716 | (342) | Grocery Outlet Holding Corp | HSBC | (1.082) |
| (450) | Graham Holdings Co 'B' | Barclays Bank | 10.586 | (14.866) | Grocery Outlet Holding Corp | Bank of America | |
| (998) | Graham Holdings Co 'B' | Goldman Sachs | 11.262 | (14.674) | Grocery Outlet Holding Corp | Merrill Lynch | 694 |
| (2.356) | Graham Holdings Co 'B' | HSBC | 37.711 | | | Barclays Bank | 20.069 |
| (293) | Graham Holdings Co 'B' | Morgan Stanley | 6.893 | | | Goldman Sachs | 29.788 |
| (24.978) | Grand Canyon Education Inc | Barclays Bank | 133.008 | | | | |
| (12.570) | Granite Construction Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 11.942 | | | | |
| (10.148) | Granite Construction Inc | Barclays Bank | 5.886 | | | | |
| (20.537) | Granite Construction Inc | Goldman Sachs | 19.510 | | | | |
| (11.238) | Granite Construction Inc | HSBC | (8.878) | | | | |
| (4.898) | Granite Construction Inc | Morgan Stanley | 2.841 | | | | |
| (25.713) | Granite Point Mortgage Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (12.085) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (6.402) | Grocery Outlet Holding Corp | Morgan Stanley | 8.643 | (567) | Hall of Fame Resort & Entertainment Co | Goldman Sachs | 164 |
| 1.248 | Group 1 Automotive Inc | Bank of America | | (1.341) | Hall of Fame Resort & Entertainment Co | HSBC | 523 |
| 2.947 | Group 1 Automotive Inc | Merrill Lynch | 4.930 | (7.354) | Hallador Energy Co | Bank of America | |
| 1.986 | Group 1 Automotive Inc | Barclays Bank | 11.641 | (8.109) | Hallador Energy Co | Merrill Lynch | 11.546 |
| 1.355 | Group 1 Automotive Inc | Goldman Sachs | 7.845 | (4.826) | Hallador Energy Co | Barclays Bank | 6.812 |
| 806 | Group 1 Automotive Inc | HSBC | 5.732 | (11.290) | Hallador Energy Co | Goldman Sachs | 7.577 |
| (31.876) | Groupon Inc | Morgan Stanley | 3.184 | (9.371) | Hallador Energy Co | HSBC | — |
| (8.315) | Groupon Inc | Barclays Bank | (17.851) | 2.994 | Halliburton Co | Morgan Stanley | 7.872 |
| (48.468) | GrowGeneration Corp | Morgan Stanley | (4.656) | 86.931 | Halliburton Co | Bank of America | |
| (1.419) | GSI Technology Inc | Barclays Bank | 3.877 | 36.417 | Halliburton Co | Merrill Lynch | (4.620) |
| (36.279) | GSI Technology Inc | Barclays Bank | 284 | 28.149 | Halliburton Co | Barclays Bank | (103.623) |
| 27.917 | GTX Inc` | Goldman Sachs | (10.884) | 690 | Halliburton Co | Goldman Sachs | (14.773) |
| 7.571 | GTX Inc` | Bank of America | | 150 | Halliburton Co | HSBC | (25.980) |
| 59 | GTX Inc` | Merrill Lynch | 28.615 | 7.571 | Hallmark Financial Services Inc | Morgan Stanley | (814) |
| 129 | Guaranty Bancshares Inc | Goldman Sachs | 7.753 | 2.360 | Hallmark Financial Services Inc | Goldman Sachs | 87 |
| 11.094 | Guaranty Bancshares Inc | Morgan Stanley | 60 | 5.259 | Halozyme Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (142) |
| 6.549 | Guaranty Bancshares Inc | Barclays Bank | 1.109 | 31.506 | Halozyme Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 3.863 | Guaranty Bancshares Inc | Goldman Sachs | 10.020 | 7.227 | Halozyme Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (6.784) |
| 3.836 | Guardant Health Inc | Morgan Stanley | 386 | 7.589 | Halozyme Therapeutics Inc | Barclays Bank | (75.300) |
| 26.954 | Guardant Health Inc | Bank of America | | 8.274 | Halozyme Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (9.323) |
| 15.919 | Guardant Health Inc | Merrill Lynch | 4.526 | 2.280 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | HSBC | 17.682 |
| (20.277) | Guess? Inc | HSBC | 149.325 | 5.551 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | Morgan Stanley | (19.775) |
| 2.169 | Guidewire Software Inc | Morgan Stanley | (29.807) | 2.733 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | Bank of America | |
| 21.546 | Guidewire Software Inc | Bank of America | | 3.408 | Hamilton Beach Brands Holding Co 'A' | Merrill Lynch | (2.599) |
| 6.602 | Guidewire Software Inc | Merrill Lynch | 5.249 | 8.420 | Hamilton Lane Inc 'A' | Barclays Bank | (2.831) |
| 8.880 | Guidewire Software Inc | Barclays Bank | 19.606 | 4.199 | Hamilton Lane Inc 'A' | Goldman Sachs | (9.658) |
| 16.346 | Guidewire Software Inc | Goldman Sachs | 15.977 | 3.830 | Hamilton Lane Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.294 |
| (32.922) | Gulf Island Fabrication Inc | HSBC | 43.778 | 14.932 | Hamilton Lane Inc 'A' | HSBC | 1.045 |
| (16.100) | Gulf Island Fabrication Inc | Morgan Stanley | 14.875 | 2.973 | Hancock Whitney Corp | Morgan Stanley | (6.838) |
| (2.154) | Gulfport Energy Corp | Barclays Bank | 2.434 | 35.218 | Hancock Whitney Corp | Barclays Bank | 8.805 |
| (591) | Gulfport Energy Corp | Goldman Sachs | (1.017) | 5.790 | Hancock Whitney Corp | Goldman Sachs | 21.076 |
| 1.195 | GXO Logistics Inc | Barclays Bank | (3.985) | 22.998 | Hancock Whitney Corp | HSBC | 80.953 |
| 6.429 | GXO Logistics Inc | HSBC | 18.162 | 10.362 | Hanesbrands Inc | Morgan Stanley | 2.591 |
| 4.774 | GXO Logistics Inc | Morgan Stanley | (15.921) | (56.716) | Hanesbrands Inc | Bank of America | |
| 2.817 | H&E Equipment Services Inc | Bank of America | | 23.399 | Hanesbrands Inc | Merrill Lynch | (1.701) |
| 9.900 | H&E Equipment Services Inc | Merrill Lynch | 1.146 | (60.664) | Hanesbrands Inc | Bank of America | |
| 8.377 | H&E Equipment Services Inc | Barclays Bank | (14.895) | 32.698 | Hanesbrands Inc | Merrill Lynch | 702 |
| 4.037 | H&E Equipment Services Inc | HSBC | 8.922 | (63.648) | Hanesbrands Inc | Barclays Bank | 5.460 |
| 3.967 | H&E Equipment Services Inc | Goldman Sachs | 8.042 | 7.843 | Hanesbrands Inc | Barclays Bank | (2.943) |
| (16.734) | H&R Block Inc | HSBC | 8.379 | (91.003) | Hanesbrands Inc | Goldman Sachs | (1.909) |
| (7.483) | H&R Block Inc | Morgan Stanley | (2.126) | 20.260 | Hanesbrands Inc | Goldman Sachs | 235 |
| (5.206) | H&R Block Inc | Goldman Sachs | 8.215 | (15.215) | Hanesbrands Inc | HSBC | 22.751 |
| (2.064) | H&R Block Inc | HSBC | 14.974 | 12.525 | Hanesbrands Inc | HSBC | (5.065) |
| 14.413 | Hackett Group Inc | Bank of America | | (5.050) | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.369 |
| 17.212 | Hackett Group Inc | Merrill Lynch | (1.783) | 750 | Hannover Insurance Group Inc | Morgan Stanley | (1.127) |
| 315 | Haemonetics Corp | Barclays Bank | 116 | (3.633) | Hannover Insurance Group Inc | Bank of America | |
| 3.878 | Haemonetics Corp | HSBC | (4.531) | 9.606 | Hannover Insurance Group Inc | Merrill Lynch | (3.954) |
| (2.697) | Haemonetics Corp | Morgan Stanley | 52 | 20.532 | Hannover Insurance Group Inc | Barclays Bank | (51.968) |
| 1.722 | Haemonetics Corp | Bank of America | | 6.892 | Hannover Insurance Group Inc | Goldman Sachs | (150.895) |
| 3.391 | Hagerty Inc 'A' | Merrill Lynch | (1.628) | | | HSBC | (50.587) |
| 1.980 | Hagerty Inc 'A' | Barclays Bank | (356) | | | | |
| 9.733 | Hagerty Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.684) | | | | |
| 6.719 | Hagerty Inc 'A' | HSBC | (3.227) | | | | |
| (5.267) | Hain Celestial Group Inc | Barclays Bank | 6.373 | | | | |
| 10.504 | Hain Celestial Group Inc | Barclays Bank | (12.710) | | | | |
| (8.162) | Hain Celestial Group Inc | HSBC | 42.524 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.731 | Hanover Insurance Group Inc | Morgan Stanley | (9.364) | 48.149 | Hawaiian Holdings Inc | Barclays Bank | 11.074 |
| 25.902 | HarborOne Bancorp Inc | Barclays Bank | (3.108) | 42.079 | Hawaiian Holdings Inc | Goldman Sachs | 30.444 |
| 20.389 | HarborOne Bancorp Inc | Goldman Sachs | 8.767 | 28.885 | Hawaiian Holdings Inc | HSBC | 8.972 |
| 13.423 | HarborOne Bancorp Inc | HSBC | 1.745 | 3.618 | Hawaiian Holdings Inc | Morgan Stanley | 832 |
| 737 | Harley-Davidson Inc | Bank of America | | 3.232 | Hawkins Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (701) | 6.263 | Hawkins Inc | Merrill Lynch | 11.538 |
| (6.241) | Harley-Davidson Inc | Barclays Bank | 5.991 | 1.041 | Hawkins Inc | Barclays Bank | (814) |
| 1.453 | Harley-Davidson Inc | Barclays Bank | (1.395) | 1.949 | Hawkins Inc | Goldman Sachs | 3.716 |
| (24.409) | Harley-Davidson Inc | Goldman Sachs | 36.125 | 2.399 | Hawkins Inc | HSBC | 11.187 |
| 1.100 | Harley-Davidson Inc | Goldman Sachs | (1.390) | (1.629) | Hawthorn Bancshares Inc | Morgan Stanley | (312) |
| (5.653) | Harley-Davidson Inc | HSBC | 23.234 | | Hawthorn Bancshares Inc | Bank of America | |
| 3.081 | Harley-Davidson Inc | HSBC | (3.522) | (529) | Hawthorn Bancshares Inc | Merrill Lynch | (16) |
| (14.053) | Harley-Davidson Inc | Morgan Stanley | 13.491 | (393) | Hawthorn Bancshares Inc | Barclays Bank | 95 |
| 1.655 | Harley-Davidson Inc | Morgan Stanley | (1.589) | (4.138) | Hawthorn Bancshares Inc | Goldman Sachs | (4) |
| (11.163) | Harmonic Inc | Barclays Bank | (12.391) | (373) | Hawthorn Bancshares Inc | Morgan Stanley | 745 |
| 4.965 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Bank of America | | | Haynes International Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (6.022) | (2.158) | Haynes International Inc | Merrill Lynch | 444 |
| 8.732 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Barclays Bank | (3.580) | (11.753) | Haynes International Inc | Barclays Bank | 4.812 |
| 9.020 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Goldman Sachs | (11.816) | (7.272) | Haynes International Inc | Goldman Sachs | 13.986 |
| 756 | Harmony Biosciences Holdings Inc | HSBC | (274) | (7.039) | Haynes International Inc | HSBC | 21.533 |
| 1.412 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Morgan Stanley | (579) | (29.227) | Hayward Holdings Inc | Morgan Stanley | 15.331 |
| (3.519) | Harrow Health Inc | Bank of America | | (86.118) | Hayward Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 6.721 | (68.222) | Hayward Holdings Inc | Merrill Lynch | 13.152 |
| (3.609) | Harrow Health Inc | Morgan Stanley | 11.928 | (69.046) | Hayward Holdings Inc | Barclays Bank | 53.393 |
| (22.545) | Harsco Corp | Barclays Bank | 14.654 | (20.564) | HB Fuller Co | Goldman Sachs | 30.700 |
| (11.910) | Harsco Corp | Goldman Sachs | 8.218 | | HB Fuller Co | HSBC | 32.452 |
| (7.313) | Harsco Corp | HSBC | 5.777 | (831) | HB Fuller Co | Bank of America | |
| 12.323 | Hartford Financial Services Group Inc | Bank of America | | (9.093) | HB Fuller Co | Merrill Lynch | 18.279 |
| | | Merrill Lynch | (25.632) | (3.759) | HB Fuller Co | Barclays Bank | 988 |
| 20.658 | Hartford Financial Services Group Inc | Barclays Bank | (57.635) | (12.099) | HB Fuller Co | Goldman Sachs | 12.083 |
| 19.669 | Hartford Financial Services Group Inc | Goldman Sachs | (40.912) | 36.794 | HBT Financial Inc | HSBC | 4.801 |
| 42.909 | Hartford Financial Services Group Inc | HSBC | (99.151) | 20.006 | HBT Financial Inc | Morgan Stanley | 7.342 |
| 19.744 | Hartford Financial Services Group Inc | Morgan Stanley | (55.086) | 13.473 | HBT Financial Inc | Barclays Bank | (736) |
| (11.835) | Harvard Bioscience Inc | Barclays Bank | 4.261 | 15.269 | HBT Financial Inc | Goldman Sachs | 12.604 |
| (21.059) | Harvard Bioscience Inc | Goldman Sachs | (3.580) | 1.103 | HCA Healthcare Inc | HSBC | 13.473 |
| (4.421) | Hasbro Inc | Bank of America | | | HCA Healthcare Inc | Morgan Stanley | (305) |
| | | Merrill Lynch | 11.097 | 3.017 | HCA Healthcare Inc | Bank of America | |
| (10.107) | Hasbro Inc | Barclays Bank | 7.176 | 1.127 | HCA Healthcare Inc | Merrill Lynch | (8.263) |
| (9.045) | Hasbro Inc | Goldman Sachs | 23.388 | 973 | HCI Group Inc | Barclays Bank | (39.356) |
| (9.190) | Hasbro Inc | HSBC | (463) | 22.779 | Health Catalyst Inc | Goldman Sachs | (8.838) |
| (5.079) | Hasbro Inc | Morgan Stanley | 3.606 | 1.607 | Health Catalyst Inc | Goldman Sachs | (456) |
| (4.077) | HashiCorp Inc 'A' | Bank of America | | (3.733) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | 535 |
| | | Merrill Lynch | (11.110) | (157.747) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| (7.365) | HashiCorp Inc 'A' | Barclays Bank | (10.605) | | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | 5.898 |
| (2.558) | HashiCorp Inc 'A' | HSBC | (9.952) | (204.126) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 108.846 |
| (1.763) | HashiCorp Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.539) | (9.147) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 322.519 |
| 2.021 | Haverty Furniture Cos Inc | Bank of America | | (15.056) | Healthcare Services Group Inc | HSBC | 14.361 |
| | | Merrill Lynch | (473) | (15.056) | Healthcare Services Group Inc | Morgan Stanley | 10.389 |
| 3.957 | Haverty Furniture Cos Inc | Barclays Bank | (1.979) | 67.157 | Healthcare Services Group Inc | Bank of America | |
| 9.379 | Haverty Furniture Cos Inc | Goldman Sachs | (749) | 2.363 | Healthcare Services Group Inc | Merrill Lynch | (44.324) |
| 699 | Haverty Furniture Cos Inc | Morgan Stanley | 114 | 35.156 | Healthcare Services Group Inc | Goldman Sachs | (1.560) |
| (2.547) | Hawaiian Electric Industries Inc | Barclays Bank | 1.605 | (8.405) | HealthEquity Inc | HSBC | (28.476) |
| (530) | Hawaiian Electric Industries Inc | Goldman Sachs | 652 | (558) | HealthEquity Inc | Bank of America | |
| (916) | Hawaiian Electric Industries Inc | HSBC | 1.724 | 2.827 | HealthEquity Inc | Merrill Lynch | 17.765 |
| (1.177) | Hawaiian Electric Industries Inc | HSBC | 1.724 | (1.817) | HealthEquity Inc | Barclays Bank | 1.986 |
| | | Morgan Stanley | 742 | 2.535 | HealthEquity Inc | Goldman Sachs | (4.862) |
| 4.594 | Hawaiian Holdings Inc | Bank of America | | (7.285) | HealthEquity Inc | HSBC | 691 |
| | | Merrill Lynch | 3.446 | 2.751 | HealthEquity Inc | Morgan Stanley | 22.876 |
| | | | | 80.069 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (9.794) |
| | | | | | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (81.670) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 113.112 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (20.360) | (3.076) | Henry Schein Inc | Goldman Sachs | 14.980 |
| 2.080 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.122) | 2.310 | Henry Schein Inc | Goldman Sachs | (11.250) |
| 23.329 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | HSBC | (30.328) | (168) | Henry Schein Inc | HSBC | 1.085 |
| 25.811 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (4.646) | 443 | Henry Schein Inc | HSBC | (661) |
| 1.722 | HealthStream Inc | Bank of America | | (387) | Henry Schein Inc | Morgan Stanley | 1.594 |
| 16.426 | HealthStream Inc | Merrill Lynch | (2.127) | (3.817) | Herbalife Ltd | Bank of America | |
| 2.502 | HealthStream Inc | Barclays Bank | (21.682) | (1.364) | Herbalife Ltd | Merrill Lynch | 10.878 |
| 22.952 | HealthStream Inc | Goldman Sachs | (2.442) | (9.645) | Herbalife Ltd | Barclays Bank | 1.637 |
| 8.234 | HealthStream Inc | HSBC | (20.257) | 12.628 | Herc Holdings Inc | Goldman Sachs | 27.488 |
| (57.180) | Heartland Express Inc | Morgan Stanley | (10.869) | 8.547 | Herc Holdings Inc | Barclays Bank | (24.103) |
| (35.722) | Heartland Express Inc | Barclays Bank | 572 | 435 | Herc Holdings Inc | Goldman Sachs | 418 |
| (6.922) | Heartland Express Inc | Goldman Sachs | (12.145) | 8.539 | Herc Holdings Inc | HSBC | 13.630 |
| 32.009 | Heartland Financial USA Inc | HSBC | (1.523) | 11.248 | Herc Holdings Inc | Morgan Stanley | (31.719) |
| 47.046 | Heartland Financial USA Inc | Bank of America | | 2.627 | Heritage Commerce Corp | Bank of America | |
| 27.273 | Heartland Financial USA Inc | Merrill Lynch | 44.218 | 128.906 | Heritage Commerce Corp | Merrill Lynch | 578 |
| 21.955 | Heartland Financial USA Inc | Barclays Bank | (14.690) | 22.655 | Heritage Commerce Corp | Barclays Bank | (28.359) |
| 4.557 | Heartland Financial USA Inc | Goldman Sachs | (1.223) | 35.186 | Heritage Commerce Corp | Goldman Sachs | 4.984 |
| (17.736) | Hecla Mining Co | HSBC | 1.774 | 6.871 | Heritage Commerce Corp | HSBC | 18.297 |
| 4.380 | HEICO Corp | Morgan Stanley | (93.820) | 38.930 | Heritage Insurance Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.512) |
| 984 | HEICO Corp | Barclays Bank | (21.038) | 15.062 | Heritage Insurance Holdings Inc | Barclays Bank | (14.015) |
| 7.097 | HEICO Corp | Goldman Sachs | (81.474) | (15.409) | Heritage-Crystal Clean Inc | Goldman Sachs | (8.585) |
| 5.925 | HEICO Corp 'A' | HSBC | (88.698) | (28.157) | Heritage-Crystal Clean Inc | Barclays Bank | 10.478 |
| 11.980 | HEICO Corp 'A' | Bank of America | (196.592) | (1.576) | Heritage-Crystal Clean Inc | Goldman Sachs | (2.534) |
| 10.008 | HEICO Corp 'A' | Merrill Lynch | (149.819) | 36.605 | Heron Therapeutics Inc | HSBC | (756) |
| 3.318 | HEICO Corp 'A' | Barclays Bank | (28.104) | 3.702 | Heron Therapeutics Inc | Barclays Bank | (10.432) |
| 1.470 | HEICO Corp 'A' | Goldman Sachs | (24.123) | 12.586 | Hersha Hospitality Trust 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (611) |
| (8.434) | Heidrick & Struggles International Inc | HSBC | 1.330 | 19.209 | Hersha Hospitality Trust 'A' (REIT) | Bank of America | (3.021) |
| (8.889) | Heidrick & Struggles International Inc | Morgan Stanley | 3.632 | 74.869 | Hersha Hospitality Trust 'A' (REIT) | Merrill Lynch | (2.113) |
| (1.830) | Helen of Troy Ltd | Barclays Bank | 5.307 | 47.476 | Hersha Hospitality Trust 'A' (REIT) | Barclays Bank | (2.113) |
| (4.707) | Helen of Troy Ltd | Goldman Sachs | 753 | 13.901 | Hersha Hospitality Trust 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (17.969) |
| (3.683) | Helen of Troy Ltd | HSBC | (2.909) | 6.357 | Hershey Co | HSBC | (15.667) |
| (1.923) | Helios Technologies Inc | Bank of America | | 18.797 | Hershey Co | Morgan Stanley | (1.529) |
| (16.013) | Helios Technologies Inc | Merrill Lynch | 9.807 | 9.079 | Hershey Co | Bank of America | |
| (4.527) | Helios Technologies Inc | Barclays Bank | 52.523 | 1.402 | Hershey Co | Merrill Lynch | (82.514) |
| (4.989) | Helios Technologies Inc | Goldman Sachs | 23.088 | 2.124 | Hershey Co | Barclays Bank | (101.504) |
| (4.807) | Helios Technologies Inc | HSBC | 62.213 | (12.527) | Hertz Global Holdings Inc | Merrill Lynch | (117.845) |
| 8.525 | Helix Energy Solutions Group Inc | Morgan Stanley | 15.767 | (17.290) | Hertz Global Holdings Inc | HSBC | (10.814) |
| 23.029 | Helix Energy Solutions Group Inc | Bank of America | (2.987) | (46.270) | Hertz Global Holdings Inc | Morgan Stanley | 82.243 |
| 12.587 | Helix Energy Solutions Group Inc | Merrill Lynch | | 468 | Hess Corp | Bank of America | |
| 5.066 | Helix Energy Solutions Group Inc | Barclays Bank | (7.449) | 1.363 | Hess Corp | Merrill Lynch | (2.489) |
| 24.625 | Helix Energy Solutions Group Inc | Goldman Sachs | (3.776) | 1.553 | Hess Corp | Barclays Bank | (11.163) |
| 35.571 | Helmerich & Payne Inc | HSBC | (2.584) | 270 | Hess Corp | Goldman Sachs | (11.403) |
| 35.778 | Helmerich & Payne Inc | Morgan Stanley | (7.743) | (1.408) | Hess Corp | HSBC | (1.140) |
| 33.853 | Helmerich & Payne Inc | Bank of America | | 73.073 | Hewlett Packard Enterprise Co | Morgan Stanley | 11.532 |
| 30.422 | Helmerich & Payne Inc | Merrill Lynch | 9.604 | 339.403 | Hewlett Packard Enterprise Co | Bank of America | |
| 37.551 | Helmerich & Payne Inc | Barclays Bank | (34.347) | 108.776 | Hewlett Packard Enterprise Co | Merrill Lynch | 14.980 |
| 10.497 | Hennessy Advisors Inc | Goldman Sachs | 9.140 | 59.206 | Hewlett Packard Enterprise Co | Barclays Bank | 15.273 |
| (958) | Henry Schein Inc | HSBC | 6.866 | 173.199 | Hewlett Packard Enterprise Co | Goldman Sachs | 22.299 |
| 3.833 | Henry Schein Inc | Morgan Stanley | (7.743) | (6.655) | Hexcel Corp | HSBC | 18.058 |
| (7.733) | Henry Schein Inc | Bank of America | | (1.811) | Hexcel Corp | Merrill Lynch | 7.794 |
| 2.782 | Henry Schein Inc | Merrill Lynch | 4.665 | (1.931) | Hexcel Corp | Barclays Bank | 22.560 |
| | | Barclays Bank | (18.667) | | | HSBC | 6.628 |
| | | Goldman Sachs | 31.860 | | | Morgan Stanley | 6.546 |
| | | HSBC | (11.462) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (17.550) | HF Foods Group Inc | Bank of America | | (1.321) | Hingham Institution | | |
| | | Merrill Lynch | 878 | | For Savings The | HSBC | (17.695) |
| (40.450) | HF Foods Group Inc | Barclays Bank | 7.281 | (473) | Hingham Institution | | |
| (15.773) | HF Foods Group Inc | Morgan Stanley | 2.839 | | For Savings The | Morgan Stanley | 3.261 |
| (1.385) | HF Sinclair Corp | Bank of America | | 1.488 | Hippo Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.345) |
| | | Merrill Lynch | 778 | 8.426 | Hippo Holdings Inc | HSBC | (20.054) |
| (2.034) | HF Sinclair Corp | Barclays Bank | 2.369 | (1.798) | HireQuest Inc | Bank of America | |
| (1.789) | HF Sinclair Corp | Goldman Sachs | 3.827 | | | Merrill Lynch | 845 |
| (2.960) | HF Sinclair Corp | Morgan Stanley | 4.107 | (2.556) | HireQuest Inc | Barclays Bank | 2.607 |
| (2.233) | Hibbett Inc | Bank of America | | (2.432) | HireQuest Inc | HSBC | (9.777) |
| | | Merrill Lynch | 27.600 | (1.523) | HireQuest Inc | Morgan Stanley | 1.553 |
| (8.201) | Hibbett Inc | Barclays Bank | 64.460 | (8.618) | HireRight Holdings Corp | Bank of America | |
| (4.483) | Hibbett Inc | Goldman Sachs | 55.410 | | | Merrill Lynch | (3.533) |
| (2.948) | Hibbett Inc | HSBC | 44.073 | (46.663) | HireRight Holdings Corp | Barclays Bank | (1.400) |
| (12.237) | HighPeak Energy Inc | Barclays Bank | 29.736 | (1.593) | HireRight Holdings Corp | Goldman Sachs | (653) |
| (862) | HighPeak Energy Inc | Morgan Stanley | 2.095 | (4.375) | HireRight Holdings Corp | HSBC | (1.400) |
| 27.890 | Highwoods Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (8.367) | (3.081) | HireRight Holdings Corp | Morgan Stanley | (92) |
| | | | | 13.535 | HNI Corp | Barclays Bank | (7.986) |
| (12.361) | Highwoods Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.112 | 2.018 | HNI Corp | HSBC | (2.179) |
| | | | | 6.250 | HNI Corp | Morgan Stanley | (3.688) |
| 6.095 | Highwoods Properties Inc (REIT) | HSBC | (7.497) | (4.224) | Holley Inc | HSBC | (2.915) |
| (7.078) | Highwoods Properties Inc (REIT) | HSBC | 8.706 | (61.620) | Holley Inc | Morgan Stanley | 19.102 |
| (1.854) | Hillenbrand Inc | Bank of America | | 3.466 | Hologic Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.835) | | | Merrill Lynch | (13.344) |
| (25.828) | Hillenbrand Inc | Barclays Bank | 16.788 | (980) | Hologic Inc | Bank of America | |
| (15.164) | Hillenbrand Inc | Goldman Sachs | (15.012) | | | Merrill Lynch | 3.773 |
| (8.872) | Hillenbrand Inc | HSBC | (15.004) | 11.914 | Hologic Inc | Barclays Bank | (37.053) |
| (2.435) | Hillenbrand Inc | Morgan Stanley | 1.583 | (1.058) | Hologic Inc | Barclays Bank | 3.290 |
| (5.832) | HilleVax Inc | HSBC | (17.204) | (1.891) | Hologic Inc | Goldman Sachs | 7.280 |
| (11.560) | Hillman Solutions Corp | Bank of America | | (2.107) | Hologic Inc | HSBC | 9.650 |
| | | Merrill Lynch | (1.040) | 11.672 | Hologic Inc | Morgan Stanley | (36.300) |
| (13.632) | Hillman Solutions Corp | Barclays Bank | 409 | (354) | Hologic Inc | Morgan Stanley | 1.101 |
| (27.999) | Hillman Solutions Corp | Goldman Sachs | (2.520) | (4.247) | Home Bancorp Inc | Goldman Sachs | (5.118) |
| (40.028) | Hillman Solutions Corp | HSBC | 400 | (648) | Home Bancorp Inc | HSBC | (1.416) |
| (35.666) | Hillman Solutions Corp | Morgan Stanley | 1.070 | (66.571) | Home BancShares Inc | Barclays Bank | 666 |
| (6.862) | Hilltop Holdings Inc | Bank of America | | (109.476) | Home BancShares Inc | Goldman Sachs | (110.571) |
| | | Merrill Lynch | 5.901 | (4.829) | Home BancShares Inc | HSBC | (5.505) |
| (22.342) | Hilltop Holdings Inc | Barclays Bank | 32.843 | (2.386) | Home Depot Inc | Barclays Bank | 12.391 |
| (9.976) | Hilltop Holdings Inc | Goldman Sachs | 8.579 | (1.464) | Home Depot Inc | HSBC | 5.214 |
| (16.234) | Hilltop Holdings Inc | HSBC | 13.474 | (4.320) | HomeStreet Inc | Bank of America | |
| (3.352) | Hilltop Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.927 | | | Merrill Lynch | 4.147 |
| (1.453) | Hilton Grand Vacations Inc | Bank of America | | (26.209) | HomeStreet Inc | Barclays Bank | 32.761 |
| | | Merrill Lynch | (2.761) | (11.994) | HomeStreet Inc | Goldman Sachs | 11.514 |
| (10.505) | Hilton Grand Vacations Inc | Barclays Bank | 19.854 | (9.524) | HomeStreet Inc | HSBC | 7.905 |
| 22.481 | Hilton Grand Vacations Inc | Barclays Bank | (42.489) | (3.881) | HomeStreet Inc | Morgan Stanley | 4.851 |
| 2.880 | Hilton Grand Vacations Inc | Goldman Sachs | 5.472 | 6.130 | HomeTrust Bancshares Inc | Bank of America | |
| (6.570) | Hilton Grand Vacations Inc | Goldman Sachs | (12.483) | | | Merrill Lynch | 5.946 |
| 11.740 | Hilton Grand Vacations Inc | HSBC | 9.466 | 43.170 | HomeTrust Bancshares Inc | Barclays Bank | (21.585) |
| 584 | Hilton Grand Vacations Inc | Morgan Stanley | (992) | 12.256 | HomeTrust Bancshares Inc | Goldman Sachs | 11.888 |
| (27.908) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Bank of America | | 10.635 | HomeTrust Bancshares Inc | HSBC | 8.508 |
| | | Merrill Lynch | 203.043 | 25.157 | Homology Medicines Inc | Bank of America | |
| (12.157) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Barclays Bank | 71.712 | | | Merrill Lynch | (1.459) |
| (8.556) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Goldman Sachs | 60.412 | 53.700 | Homology Medicines Inc | Barclays Bank | (4.189) |
| (11.857) | Hilton Worldwide Holdings Inc | HSBC | 116.310 | 24.543 | Homology Medicines Inc | Goldman Sachs | (1.423) |
| (7.569) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Morgan Stanley | 61.990 | 15.531 | Homology Medicines Inc | HSBC | (745) |
| 19.784 | Hims & Hers Health Inc | Goldman Sachs | (29.051) | 5.738 | Homology Medicines Inc | Morgan Stanley | (448) |
| 2.186 | Hims & Hers Health Inc | HSBC | (1.327) | (18.270) | Honest Co Inc | Bank of America | |
| 2.094 | Hims & Hers Health Inc | Morgan Stanley | (371) | | | Merrill Lynch | 8.404 |
| (795) | Hingham Institution | Bank of America | | (11.227) | Honest Co Inc | Barclays Bank | 1.684 |
| | | Merrill Lynch | (6.299) | (53.270) | Honest Co Inc | HSBC | 8.523 |
| (1.537) | Hingham Institution | Barclays Bank | 10.598 | (55.527) | Honest Co Inc | Morgan Stanley | 8.329 |
| | | | | 9.765 | Honeywell International Inc | Bank of America | |
| (811) | Hingham Institution | Goldman Sachs | (7.928) | | | Merrill Lynch | (25.487) |
| | | | | 23.475 | Honeywell International Inc | Barclays Bank | (122.774) |
| | | | | 2.288 | Honeywell International Inc | Goldman Sachs | (6.167) |
| | | | | 10.218 | Honeywell International Inc | HSBC | (53.645) |
| | | | | 8.507 | Honeywell International Inc | Morgan Stanley | (44.492) |
| | | | | (3.344) | Hooker Furnishings Corp | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 936 |
| | | | | (2.891) | Hooker Furnishings Corp | Barclays Bank | 867 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (10.854) | Hooker Furnishings Corp | Goldman Sachs | 3.039 | (653) | HubSpot Inc | Barclays Bank | (13.432) |
| (4.475) | Hooker Furnishings Corp | HSBC | (2.372) | (252) | HubSpot Inc | Morgan Stanley | (5.184) |
| (1.556) | Hooker Furnishings Corp | Morgan Stanley | 467 | 136.141 | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 28.849 |
| (6.457) | Horace Mann Educators Corp | Barclays Bank | 7.296 | 58.030 | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (4.352) |
| 12.331 | Horizon Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.701 | 45 | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 13 |
| 50.003 | Horizon Bancorp Inc | Barclays Bank | 6.250 | 28.308 | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | HSBC | (9.336) |
| 101.124 | Horizon Bancorp Inc | Goldman Sachs | 104.158 | 108.674 | Hudson Pacific Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (8.151) |
| 43.298 | Horizon Bancorp Inc | HSBC | 40.700 | (25.793) | Hudson Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.579) |
| 31.563 | Horizon Bancorp Inc | Morgan Stanley | 3.945 | (3.642) | Hudson Technologies Inc | Barclays Bank | 1.930 |
| (12.065) | Hormel Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | 18.701 | (8.112) | Hudson Technologies Inc | Goldman Sachs | (811) |
| 662 | Hormel Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.026) | (11.373) | Hudson Technologies Inc | HSBC | (7.233) |
| (41.050) | Hormel Foods Corp | Barclays Bank | 33.661 | (10.367) | Hudson Technologies Inc | Morgan Stanley | 5.495 |
| 2.616 | Hormel Foods Corp | Barclays Bank | (2.145) | 13.205 | Humacyte Inc | Barclays Bank | (9.508) |
| (59.967) | Hormel Foods Corp | Goldman Sachs | 92.949 | 896 | Humacyte Inc | Goldman Sachs | (381) |
| (22.244) | Hormel Foods Corp | HSBC | 57.167 | 5.717 | Humacyte Inc | Morgan Stanley | (4.116) |
| (9.268) | Hormel Foods Corp | Morgan Stanley | 7.600 | (1.804) | Humana Inc | Barclays Bank | 26.257 |
| (1.317) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 823 | (5.167) | Humana Inc | Goldman Sachs | 119.229 |
| (16.381) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | Barclays Bank | 13.515 | (681) | Humana Inc | HSBC | 24.880 |
| (11.145) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | HSBC | 12.538 | (647) | Humana Inc | Morgan Stanley | 9.417 |
| (4.747) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | Morgan Stanley | 3.916 | (69.167) | Huntington Bancshares Inc | Barclays Bank | 3.458 |
| 40.520 | Hostess Brands Inc | Barclays Bank | (30.390) | (15.496) | Huntington Bancshares Inc | HSBC | (11.313) |
| 16.691 | Hostess Brands Inc | Goldman Sachs | (19.528) | (58.324) | Huntington Bancshares Inc | Morgan Stanley | 2.916 |
| 13.030 | Hostess Brands Inc | HSBC | (17.591) | (3.077) | Huntington Ingalls Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11.487) |
| 5.082 | Hostess Brands Inc | Morgan Stanley | (3.812) | (1.041) | Huntington Ingalls Industries Inc | Barclays Bank | 1.936 |
| 4.646 | Houlihan Lokey Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.973) | (395) | Huntington Ingalls Industries Inc | HSBC | (58) |
| 6.179 | Houlihan Lokey Inc | Barclays Bank | 2.039 | (4.888) | Huntington Ingalls Industries Inc | Morgan Stanley | 8.141 |
| 15.475 | Houlihan Lokey Inc | Goldman Sachs | (9.410) | 16.865 | Huntsman Corp | Bank of America Merrill Lynch | (21.925) |
| 5.739 | Houlihan Lokey Inc | HSBC | 11.602 | 50.726 | Huntsman Corp | Barclays Bank | (80.655) |
| 2.348 | Houlihan Lokey Inc | Morgan Stanley | 640 | 30.102 | Huntsman Corp | Goldman Sachs | (39.133) |
| (309) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.256) | 30.424 | Huntsman Corp | HSBC | (62.674) |
| (8.096) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | Barclays Bank | 4.696 | 10.839 | Huntsman Corp | Morgan Stanley | (17.234) |
| (1.379) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | (10.067) | 5.498 | Hurco Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.914) |
| (2.798) | Hovnanian Enterprises Inc 'A' | HSBC | (36.514) | 5.577 | Hurco Cos Inc | Barclays Bank | (1.506) |
| 5.072 | Howard Hughes Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.217) | 6.095 | Hurco Cos Inc | Goldman Sachs | (3.230) |
| 1.096 | Howard Hughes Corp | Barclays Bank | (406) | 4.059 | Hurco Cos Inc | HSBC | — |
| 7.683 | Howard Hughes Corp | HSBC | (16.749) | 8.633 | Hurco Cos Inc | Morgan Stanley | (2.331) |
| 2.978 | Howard Hughes Corp | Morgan Stanley | (1.102) | (372) | Huron Consulting Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (108) |
| (15.436) | Howmet Aerospace Inc | Bank of America Merrill Lynch | 27.899 | (1.248) | Huron Consulting Group Inc | Barclays Bank | 2.434 |
| (89.784) | Howmet Aerospace Inc | Barclays Bank | 171.753 | 4.126 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (21.393) |
| (53.010) | Howmet Aerospace Inc | Goldman Sachs | 92.313 | 2.801 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Barclays Bank | (7.367) |
| (25.186) | Howmet Aerospace Inc | HSBC | 27.265 | 5.749 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Goldman Sachs | (31.045) |
| (16.831) | Howmet Aerospace Inc | Morgan Stanley | 33.310 | 1.997 | Hyatt Hotels Corp 'A' | HSBC | (12.557) |
| 4.771 | HP Inc | Bank of America Merrill Lynch | 859 | (5.161) | Hyatt Hotels Corp 'A' | Morgan Stanley | 13.573 |
| 2.143 | HP Inc | Barclays Bank | (2.057) | 1.615 | Hyatt Hotels Corp 'A' | Morgan Stanley | (4.247) |
| 41.016 | HP Inc | Goldman Sachs | 7.383 | (19.599) | Hydrofarm Holdings Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.932 |
| 52.276 | HP Inc | HSBC | (23.001) | (29.257) | Hydrofarm Holdings Group Inc | Goldman Sachs | 4.377 |
| 35.314 | HP Inc | Morgan Stanley | (33.902) | (81.123) | Hyllion Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.462 |
| 7.907 | Hub Group Inc 'A' | Barclays Bank | (13.837) | (101.017) | Hyllion Holdings Corp | Barclays Bank | 10.607 |
| 14.309 | Hub Group Inc 'A' | HSBC | 429 | (9.810) | Hyllion Holdings Corp | Goldman Sachs | 540 |
| 278 | Hub Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (447) | (51.398) | Hyllion Holdings Corp | Morgan Stanley | 5.397 |
| (2.212) | Hubbell Inc | Bank of America Merrill Lynch | (27.185) | (1.244) | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.205 |
| (3.229) | Hubbell Inc | Morgan Stanley | (10.914) | | | | |
| 319 | HubSpot Inc | Barclays Bank | 6.562 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (5.711) | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Barclays Bank | 28.898 | 7.454 | IDT Corp 'B' | HSBC | (16.339) |
| (1.030) | Hyster-Yale Materials Handling Inc | HSBC | 4.289 | 6.667 | IDT Corp 'B' | Morgan Stanley | (21.201) |
| (1.051) | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Morgan Stanley | 5.318 | (3.504) | IES Holdings Inc | Bank of America | |
| (889) | I3 Verticals Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 3.539 |
| (10.295) | I3 Verticals Inc 'A' | Merrill Lynch | (1.085) | (2.384) | IES Holdings Inc | Barclays Bank | 6.532 |
| (3.242) | I3 Verticals Inc 'A' | Barclays Bank | 3.294 | (2.091) | IES Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.112 |
| 657 | IAC Inc | HSBC | 1.297 | (1.732) | IES Holdings Inc | HSBC | (5.750) |
| 731 | IAC Inc | Bank of America | | (5.190) | IES Holdings Inc | Morgan Stanley | 14.221 |
| (2.313) | IAC Inc | Merrill Lynch | (255) | 2.759 | IGM Biosciences Inc | Barclays Bank | (1.380) |
| 4.819 | IBEX Holdings Ltd | Goldman Sachs | (2.675) | 1.334 | IGM Biosciences Inc | HSBC | (1.281) |
| 5.989 | IBEX Holdings Ltd | Goldman Sachs | 8.466 | 18.820 | iHeartMedia Inc 'A' | Bank of America | |
| 8.710 | IBEX Holdings Ltd | Barclays Bank | (8.205) | | | Merrill Lynch | (4.046) |
| 860 | IBEX Holdings Ltd | Goldman Sachs | 13.239 | 21.385 | iHeartMedia Inc 'A' | Barclays Bank | (6.095) |
| 7.759 | IBEX Holdings Ltd | HSBC | 1.324 | 17.275 | iHeartMedia Inc 'A' | HSBC | (12.179) |
| (1.279) | ICF International Inc | Morgan Stanley | (9.676) | 26.771 | iHeartMedia Inc 'A' | Morgan Stanley | (7.630) |
| (2.577) | ICF International Inc | Bank of America | | 768 | Illinois Tool Works Inc | Bank of America | |
| (5.773) | ICF International Inc | Merrill Lynch | 4.540 | | | Merrill Lynch | (7.519) |
| (1.851) | ICF International Inc | Barclays Bank | 7.267 | 2.005 | Illinois Tool Works Inc | Barclays Bank | (15.739) |
| (2.144) | ICF International Inc | Goldman Sachs | 20.494 | 11.403 | Illinois Tool Works Inc | Goldman Sachs | (111.636) |
| (2.935) | Ichor Holdings Ltd | HSBC | 2.502 | 13.262 | Illinois Tool Works Inc | HSBC | (121.348) |
| (9.409) | Ichor Holdings Ltd | Morgan Stanley | 6.046 | 1.742 | Illinois Tool Works Inc | Morgan Stanley | (13.675) |
| (3.889) | Ichor Holdings Ltd | Bank of America | | (3.392) | Illumina Inc | Bank of America | |
| (16.447) | Ichor Holdings Ltd | Merrill Lynch | (405) | | | Merrill Lynch | 22.958 |
| (298) | ICON Plc | Barclays Bank | 70.540 | (4.342) | Illumina Inc | Barclays Bank | 64.001 |
| (8.108) | ICON Plc | Goldman Sachs | (2.939) | (6.303) | Illumina Inc | HSBC | 22.050 |
| (2.161) | ICON Plc | HSBC | (68.660) | (781) | Illumina Inc | Morgan Stanley | 6.195 |
| (3.946) | ICON Plc | Morgan Stanley | 16.870 | (9.281) | IMAX Corp | Barclays Bank | 15.314 |
| (1.939) | ICON Plc | Bank of America | | (67.601) | Immersion Corp | Barclays Bank | 8.112 |
| 2.727 | Icosavax Inc | Merrill Lynch | 3.218 | 4.085 | Immuneering Corp 'A' | Barclays Bank | (4.534) |
| 2.130 | Icosavax Inc | HSBC | 6.497 | 2.351 | Immuneering Corp 'A' | Goldman Sachs | (2.092) |
| (87) | ICU Medical Inc | Bank of America | | 628 | Immuneering Corp 'A' | HSBC | (94) |
| (9.921) | ICU Medical Inc | Merrill Lynch | 2.633 | 2.268 | Immuneering Corp 'A' | Morgan Stanley | (2.517) |
| (2.398) | ICU Medical Inc | Barclays Bank | 226.694 | (22.416) | Immunic Inc | Bank of America | |
| (6.350) | ICU Medical Inc | Goldman Sachs | 72.587 | | | Merrill Lynch | 897 |
| (5.669) | ICU Medical Inc | HSBC | 96.012 | (1.232) | Immunic Inc | Barclays Bank | 308 |
| 11.006 | IDACORP Inc | Morgan Stanley | 129.537 | (4.227) | Immunic Inc | Goldman Sachs | 169 |
| 58.366 | IDACORP Inc | Bank of America | | 3.703 | ImmunoGen Inc | Bank of America | |
| 12.064 | IDACORP Inc | Merrill Lynch | (55.690) | | | Merrill Lynch | 1.000 |
| 12.454 | IDACORP Inc | Barclays Bank | (198.444) | (10.795) | Immunovant Inc | Barclays Bank | 30.010 |
| 13.258 | IDACORP Inc | Goldman Sachs | (61.044) | (1.403) | Impinj Inc | Barclays Bank | (505) |
| 10.642 | Ideaya Biosciences Inc | HSBC | 31.926 | (1.181) | Impinj Inc | Goldman Sachs | (5.043) |
| 6.941 | Ideaya Biosciences Inc | Morgan Stanley | 1.180 | (3.511) | Impinj Inc | HSBC | (15.413) |
| (12.958) | Identiv Inc | Bank of America | | (759) | Impinj Inc | Morgan Stanley | (273) |
| (20.311) | Identiv Inc | Merrill Lynch | (3.240) | 2.005 | Inari Medical Inc | Bank of America | |
| (16.843) | Identiv Inc | Barclays Bank | 203 | | | Merrill Lynch | (16.599) |
| (573) | IDEX Corp | Goldman Sachs | (4.211) | 1.177 | Inari Medical Inc | Barclays Bank | (76) |
| (2.173) | IDEX Corp | Bank of America | | (4.302) | Inari Medical Inc | Goldman Sachs | 46.548 |
| (1.198) | IDEX Corp | Merrill Lynch | 4.154 | 2.443 | Inari Medical Inc | HSBC | (5.187) |
| (15.295) | IDEX Corp | Barclays Bank | 17.471 | 1.323 | Inari Medical Inc | Morgan Stanley | (4.353) |
| 115 | IDEXX Laboratories Inc | Goldman Sachs | 6.905 | 7.851 | Incyte Corp | Bank of America | |
| 5.178 | IDEXX Laboratories Inc | HSBC | 152.272 | | | Merrill Lynch | (33.524) |
| 956 | IDEXX Laboratories Inc | Morgan Stanley | (3.426) | 30.736 | Incyte Corp | Barclays Bank | (75.610) |
| 922 | IDEXX Laboratories Inc | Bank of America | (135.456) | 10.607 | Incyte Corp | Goldman Sachs | (45.292) |
| 6.423 | IDT Corp 'B' | Merrill Lynch | (24.320) | 20.669 | Incyte Corp | HSBC | (79.179) |
| 4.410 | IDT Corp 'B' | Barclays Bank | (13.360) | 16.783 | Incyte Corp | Morgan Stanley | (41.286) |
| | | Goldman Sachs | (9.173) | 11.569 | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| | | | | 24.114 | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | 1.504 |
| | | | | 46.304 | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 8.439 |
| | | | | 112.985 | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 6.020 |
| | | | | 27.688 | Independence Realty Trust Inc (REIT) | HSBC | 15.871 |
| | | | | 30.531 | Independent Bank Corp | Morgan Stanley | 9.691 |
| | | | | (14.669) | Independent Bank Corp | Bank of America | |
| | | | | 71.099 | Independent Bank Corp | Merrill Lynch | 18.624 |
| | | | | 44.574 | Independent Bank Corp | Barclays Bank | 47.968 |
| | | | | | Independent Bank Corp | Barclays Bank | (39.104) |
| | | | | | Independent Bank Corp | Goldman Sachs | 27.190 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (4.669) | Independent Bank Corp | Goldman Sachs | 6.863 | (20.349) | Innodata Inc | Barclays Bank | (27.471) |
| (3.716) | Independent Bank Corp | HSBC | 11.259 | (3.851) | Innodata Inc | Goldman Sachs | (6.470) |
| 16.559 | Independent Bank Corp | Morgan Stanley | (9.107) | 1.010 | Innospec Inc | Bank of America | |
| (7.693) | Independent Bank Group Inc | Barclays Bank | 7.385 | 8.333 | Innospec Inc | Merrill Lynch | (4.050) |
| (33.644) | indie Semiconductor Inc 'A' | Barclays Bank | (8.579) | 5.725 | Innospec Inc | Goldman Sachs | (33.415) |
| (6.404) | indie Semiconductor Inc 'A' | HSBC | (8.357) | (2.140) | Innovage Holding Corp | HSBC | (28.167) |
| (62.280) | indie Semiconductor Inc 'A' | Morgan Stanley | (15.881) | | Innovage Holding Corp | Bank of America | |
| (3.769) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | | (2.836) | Innovage Holding Corp | Merrill Lynch | 342 |
| (3.468) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | Merrill Lynch | (415) | (15.897) | Innovage Holding Corp | Barclays Bank | 2.581 |
| (5.547) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 35 | (9.044) | Innovage Holding Corp | Goldman Sachs | 2.544 |
| (3.737) | Indus Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (610) | (16.514) | INNOVATE Corp | HSBC | 2.261 |
| 34.459 | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Barclays Bank | (523) | (48.441) | INNOVATE Corp | Bank of America | 5.780 |
| 39.372 | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | HSBC | (1.378) | (10.836) | INNOVATE Corp | Barclays Bank | 9.204 |
| 82.245 | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Bank of America | (3.290) | (50.317) | Innovid Corp | Goldman Sachs | 3.793 |
| 5.345 | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Merrill Lynch | (748) | (10.885) | Innoviva Inc | Barclays Bank | (12.655) |
| 32.205 | Industrial Logistics Properties Trust (REIT) | Barclays Bank | (2.576) | (60.728) | Innoviva Inc | Bank of America | |
| (7.240) | Infinera Corp | Goldman Sachs | (941) | (9.182) | Innoviva Inc | Merrill Lynch | (3.919) |
| (3.912) | Infinera Corp | Bank of America | (430) | (1.677) | Inogen Inc | Barclays Bank | 22.469 |
| (46.739) | Infinera Corp | Merrill Lynch | 6.543 | 1.226 | Inogen Inc | HSBC | (14.599) |
| 31.749 | Informatica Inc 'A' | HSBC | 66.355 | 1.728 | Inogen Inc | Morgan Stanley | 620 |
| 35.171 | Informatica Inc 'A' | Bank of America | 16.178 | 13.130 | Inogen Inc | Bank of America | 270 |
| 10.417 | Informatica Inc 'A' | Merrill Lynch | 21.772 | 5.541 | Inogen Inc | Merrill Lynch | 270 |
| 20.725 | Informatica Inc 'A' | Barclays Bank | 50.569 | 2.919 | Inotiv Inc | Barclays Bank | (484) |
| 5.208 | Informatica Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.396 | (197) | Inotiv Inc | Goldman Sachs | 2.889 |
| 56.821 | Information Services Group Inc | HSBC | (4.546) | (7.907) | Inotiv Inc | HSBC | (4.544) |
| 23.730 | Information Services Group Inc | Bank of America | (6.170) | (26.917) | Inovio Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (817) |
| 40.469 | Information Services Group Inc | Merrill Lynch | (3.238) | (10.634) | Inovio Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 12.226 | Information Services Group Inc | Barclays Bank | 1.345 | 3.456 | Inozyme Pharma Inc | Merrill Lynch | 270 |
| 45.080 | Information Services Group Inc | Goldman Sachs | (11.721) | 5.796 | Inozyme Pharma Inc | Barclays Bank | (484) |
| (8.616) | InfuSystem Holdings Inc | HSBC | 1.034 | 5.251 | Inozyme Pharma Inc | Goldman Sachs | 2.889 |
| (22.828) | InfuSystem Holdings Inc | Bank of America | 3.881 | 24.078 | Inseego Corp | HSBC | (4.544) |
| (4.079) | InfuSystem Holdings Inc | Merrill Lynch | (1.061) | 23.656 | Inseego Corp | Merrill Lynch | 1.445 |
| (37.754) | Ingersoll Rand Inc | Barclays Bank | 89.701 | 9.601 | Inseego Corp | Barclays Bank | 1.892 |
| (17.158) | Ingersoll Rand Inc | Goldman Sachs | 28.139 | 5.733 | Inseego Corp | Goldman Sachs | 576 |
| (17.989) | Ingersoll Rand Inc | HSBC | 28.929 | 3.774 | Inseego Corp | HSBC | (459) |
| (19.465) | Ingersoll Rand Inc | Morgan Stanley | 24.770 | 7.420 | Inseego Corp | Morgan Stanley | 302 |
| 5.606 | Ingevity Corp | Barclays Bank | (20.182) | 628 | Insight Enterprises Inc | Barclays Bank | 23.225 |
| 1.228 | Ingevity Corp | Goldman Sachs | (7.257) | 8.676 | Insight Enterprises Inc | HSBC | 6.074 |
| 2.194 | Ingevity Corp | Morgan Stanley | (7.898) | (3.646) | Insmed Inc | Morgan Stanley | 27.156 |
| (9.756) | Ingles Markets Inc 'A' | Barclays Bank | 1.756 | (10.545) | Insmed Inc | Bank of America | |
| (1.427) | Ingles Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | (885) | (6.894) | Insmed Inc | Merrill Lynch | 1.787 |
| (1.542) | Ingles Markets Inc 'A' | HSBC | (894) | 29.323 | Insperty Inc | Barclays Bank | 16.134 |
| (2.302) | Ingredion Inc | Bank of America | | 39.196 | Insperty Inc | Morgan Stanley | 10.548 |
| (2.409) | Ingredion Inc | Merrill Lynch | 13.098 | 14.094 | Insperty Inc | Bank of America | |
| (2.200) | Ingredion Inc | Barclays Bank | 16.743 | 3.399 | Insperty Inc | Merrill Lynch | (46.624) |
| (6.997) | Inhibrx Inc | Goldman Sachs | 15.290 | 10.356 | Inspire Medical Systems Inc | Barclays Bank | (154.040) |
| (2.257) | Inhibrx Inc | HSBC | 10.705 | 2.227 | Inspire Medical Systems Inc | Goldman Sachs | (22.410) |
| (2.217) | Inhibrx Inc | Bank of America | 2.392 | (233) | Inspire Medical Systems Inc | HSBC | (20.462) |
| (3.355) | Inhibrx Inc | Merrill Lynch | 6.274 | 472 | Inspire Medical Systems Inc | Morgan Stanley | (40.699) |
| (13.344) | Innodata Inc | Barclays Bank | 3.556 | (2.639) | Inspired Entertainment Inc | Barclays Bank | (38.861) |
| | | Goldman Sachs | (22.418) | | Inspired Entertainment Inc | Goldman Sachs | 1.266 |
| | | HSBC | | | Inspired Entertainment Inc | HSBC | 4.731 |
| | | Bank of America | | | Inspired Entertainment Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | | | Inspired Entertainment Inc | Merrill Lynch | 1.108 |
| | | Barclays Bank | | | Inspired Entertainment Inc | Barclays Bank | 11.737 |
| | | Goldman Sachs | | | Inspired Entertainment Inc | Goldman Sachs | 1.598 |
| | | HSBC | | | Inspired Entertainment Inc | HSBC | (6.961) |
| | | Morgan Stanley | | | Inspired Entertainment Inc | Morgan Stanley | 248 |
| | | Bank of America | | | Installed Building Products Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | | | Installed Building Products Inc | Merrill Lynch | (34.854) |
| | | Barclays Bank | | | Installed Building Products Inc | Barclays Bank | (14.117) |
| | | HSBC | | | Installed Building Products Inc | HSBC | (64.825) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.149 | Installed Building Products Inc | Morgan Stanley | (4.585) | 1.827 | Intercontinental Exchange Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9.610) |
| (753) | Insteel Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (489) | 618 | Intercontinental Exchange Inc | Barclays Bank | (2.830) |
| (5.983) | Insteel Industries Inc | Barclays Bank | (239) | (1.947) | Intercontinental Exchange Inc | Barclays Bank | 8.917 |
| (9.084) | Insteel Industries Inc | Goldman Sachs | (5.905) | 9.151 | Intercontinental Exchange Inc | Goldman Sachs | (48.134) |
| (13.726) | Insteel Industries Inc | HSBC | (24.127) | 5.676 | Intercontinental Exchange Inc | HSBC | (14.871) |
| (7.949) | Insteel Industries Inc | Morgan Stanley | (46) | (234) | InterDigital Inc | Bank of America Merrill Lynch | (91) |
| (7.868) | Instructure Holdings Inc | Barclays Bank | (1.962) | (5.287) | InterDigital Inc | Barclays Bank | 8.724 |
| (18.514) | Instructure Holdings Inc | Goldman Sachs | (10.553) | (2.001) | InterDigital Inc | Morgan Stanley | 3.302 |
| (2.327) | Instructure Holdings Inc | HSBC | 2.676 | 18.544 | Interface Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.113) |
| (2.285) | Instructure Holdings Inc | Morgan Stanley | (614) | 32.874 | Interface Inc | Barclays Bank | (7.890) |
| 218 | Insulet Corp | Bank of America Merrill Lynch | (10.152) | 22.119 | Interface Inc | Goldman Sachs | (1.327) |
| 857 | Insulet Corp | Barclays Bank | (27.707) | 15.123 | Interface Inc | HSBC | (3.327) |
| 1.357 | Insulet Corp | HSBC | (60.739) | 43.387 | Interface Inc | Morgan Stanley | (10.413) |
| 1.261 | Insulet Corp | Morgan Stanley | (40.768) | (694) | International Bancshares Corp | Bank of America Merrill Lynch | 880 |
| 1.393 | Intapp Inc | Barclays Bank | 3.650 | (3.962) | International Bancshares Corp | Barclays Bank | 3.843 |
| 4.416 | Intapp Inc | Goldman Sachs | (4.328) | (6.906) | International Bancshares Corp | Goldman Sachs | (8.633) |
| 1.292 | Intapp Inc | HSBC | 6.202 | (6.656) | International Bancshares Corp | HSBC | (12.609) |
| 3.800 | Intapp Inc | Morgan Stanley | 9.956 | (5.632) | International Bancshares Corp | Morgan Stanley | 5.339 |
| (1.909) | Integer Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.216) | (1.851) | International Business Machines Corp | Bank of America Merrill Lynch | (10.033) |
| (7.254) | Integer Holdings Corp | Barclays Bank | 2.104 | (14.591) | International Business Machines Corp | Barclays Bank | (18.676) |
| (3.696) | Integer Holdings Corp | Goldman Sachs | (8.723) | (24.310) | International Business Machines Corp | Goldman Sachs | (131.760) |
| (1.369) | Integer Holdings Corp | HSBC | (2.567) | (13.067) | International Business Machines Corp | HSBC | (70.300) |
| (3.840) | Integer Holdings Corp | Morgan Stanley | 354 | (1.764) | International Business Machines Corp | Morgan Stanley | (2.258) |
| (1.034) | Integra LifeSciences Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 665 | (8.436) | International Flavors & Fragrances Inc | Barclays Bank | 52.050 |
| 7.332 | Integra LifeSciences Holdings Corp | Barclays Bank | (94.509) | 1.847 | International Flavors & Fragrances Inc | Barclays Bank | (11.396) |
| 14.165 | Integra LifeSciences Holdings Corp | Goldman Sachs | (163.889) | 781 | International Flavors & Fragrances Inc | Goldman Sachs | (2.740) |
| 5.810 | Integra LifeSciences Holdings Corp | Morgan Stanley | (74.891) | (5.136) | International Flavors & Fragrances Inc | HSBC | 102.258 |
| 10.010 | Integral Ad Science Holding Corp | Barclays Bank | 11.962 | 3.342 | International Flavors & Fragrances Inc | HSBC | (16.870) |
| 17.585 | Integral Ad Science Holding Corp | Goldman Sachs | 48.865 | 1.069 | International Flavors & Fragrances Inc | Morgan Stanley | (6.596) |
| 32.748 | Intel Corp | Bank of America Merrill Lynch | 16.914 | 1.749 | International Game Technology Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.803) |
| 15.520 | Intel Corp | Barclays Bank | 33.106 | 19.194 | International Game Technology Plc | Barclays Bank | (33.013) |
| 21.012 | Intel Corp | Goldman Sachs | 12.022 | 4.707 | International Game Technology Plc | Goldman Sachs | (8.284) |
| 38.861 | Intel Corp | HSBC | (13.811) | 13.192 | International Game Technology Plc | HSBC | (39.181) |
| 10.315 | Intel Corp | Morgan Stanley | 516 | (24.326) | International Game Technology Plc | HSBC | 72.248 |
| 11.005 | Intellia Therapeutics Inc | Barclays Bank | (74.944) | 4.937 | International Game Technology Plc | Morgan Stanley | (8.491) |
| (1.448) | Intellia Therapeutics Inc | HSBC | 11.918 | (10.048) | International Money Express Inc | Goldman Sachs | — |
| 4.088 | Intellia Therapeutics Inc | HSBC | (22.934) | (1.305) | International Money Express Inc | Morgan Stanley | 900 |
| (1.023) | Intellia Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 6.967 | (4.728) | International Paper Co | Barclays Bank | 9.787 |
| (8.246) | Intellicheck Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.639) | 9.893 | International Paper Co | Goldman Sachs | (21.369) |
| (56.390) | Intellicheck Inc | Barclays Bank | (15.225) | | | | |
| 851 | Inter Parfums Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.565) | | | | |
| 226 | Inter Parfums Inc | Goldman Sachs | (969) | | | | |
| 4.345 | Inter Parfums Inc | Morgan Stanley | (25.071) | | | | |
| 8.312 | Interactive Brokers Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 11.637 | | | | |
| 5.000 | Interactive Brokers Group Inc 'A' | Barclays Bank | 11.550 | | | | |
| 553 | Interactive Brokers Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 774 | | | | |
| 781 | Interactive Brokers Group Inc 'A' | HSBC | (78) | | | | |
| 4.286 | Interactive Brokers Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 9.901 | | | | |
| 19.782 | Intercept Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 21.958 | | | | |
| 3.685 | Intercept Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (16.585) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (762) | International Paper Co | HSBC | 725 | 14.575 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 14.336 | International Paper Co | Morgan Stanley | (29.676) | | | Merrill Lynch | 62.381 |
| 4.275 | International Seaways Inc | Bank of America | | (898) | Ionis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 26 |
| | | Merrill Lynch | (11.756) | (1.961) | Ionis Pharmaceuticals Inc | HSBC | 417 |
| 419 | International Seaways Inc | Goldman Sachs | (1.152) | 9.017 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.713) |
| 1.364 | International Seaways Inc | HSBC | (2.264) | (10.297) | IonQ Inc | HSBC | (46.131) |
| 3.976 | International Seaways Inc | Morgan Stanley | (9.741) | (49.223) | IonQ Inc | Morgan Stanley | 11.321 |
| (13.702) | Interpublic Group of Cos Inc | Bank of America | | 16.790 | Iovance Biotherapeutics Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (469) | | | Merrill Lynch | 17.042 |
| (29.057) | Interpublic Group of Cos Inc | Barclays Bank | (2.232) | (8.729) | Iovance Biotherapeutics Inc | Bank of America | |
| (15.650) | Interpublic Group of Cos Inc | Goldman Sachs | (8.072) | | | Merrill Lynch | (8.860) |
| (11.517) | Interpublic Group of Cos Inc | HSBC | (18.129) | (6.598) | Iovance Biotherapeutics Inc | Goldman Sachs | (6.697) |
| (36.174) | Interpublic Group of Cos Inc | Morgan Stanley | (2.104) | 3.655 | Iovance Biotherapeutics Inc | HSBC | 6.488 |
| 3.806 | inTEST Corp | Bank of America | | (6.447) | Iovance Biotherapeutics Inc | HSBC | (11.443) |
| | | Merrill Lynch | (1.170) | (8.797) | IPG Photonics Corp | Barclays Bank | 6.598 |
| 3.797 | inTEST Corp | Goldman Sachs | 304 | (3.176) | IPG Photonics Corp | Goldman Sachs | (2.223) |
| 5.677 | inTEST Corp | HSBC | (1.043) | (11.040) | IPG Photonics Corp | HSBC | 37.536 |
| 9.847 | inTEST Corp | Morgan Stanley | (3.828) | (16.706) | IPG Photonics Corp | Morgan Stanley | 12.529 |
| (4.936) | Intevac Inc | Bank of America | | 916 | IQVIA Holdings Inc | Barclays Bank | (5.056) |
| | | Merrill Lynch | 49 | 121 | IQVIA Holdings Inc | HSBC | 609 |
| (782) | Intevac Inc | Barclays Bank | 211 | 233 | IQVIA Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.286) |
| (30.794) | Intevac Inc | Goldman Sachs | 308 | 892 | iRadimed Corp | Bank of America | |
| (900) | Intevac Inc | HSBC | 90 | | | Merrill Lynch | 54 |
| 1.742 | Intra-Cellular Therapies Inc | Barclays Bank | (4.059) | 5.551 | iRadimed Corp | Barclays Bank | 167 |
| 4.412 | Intra-Cellular Therapies Inc | Goldman Sachs | (20.295) | 3.874 | iRadimed Corp | Goldman Sachs | 232 |
| 661 | Intra-Cellular Therapies Inc | HSBC | (2.472) | 1.798 | iRadimed Corp | HSBC | (2.967) |
| (789) | Intra-Cellular Therapies Inc | Morgan Stanley | 1.838 | 680 | iRadimed Corp | Morgan Stanley | 20 |
| (1.626) | Intrepid Potash Inc | Bank of America | | (1.527) | iRhythm Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.797 | | | Merrill Lynch | 24.898 |
| (5.405) | Intrepid Potash Inc | Barclays Bank | 10.270 | (1.861) | iRhythm Technologies Inc | Barclays Bank | 31.377 |
| (770) | Intrepid Potash Inc | Goldman Sachs | 1.324 | (5.904) | iRhythm Technologies Inc | Goldman Sachs | 104.914 |
| (4.156) | Intrepid Potash Inc | HSBC | 8.693 | (6.472) | iRhythm Technologies Inc | HSBC | 101.044 |
| (2.632) | Intrepid Potash Inc | Morgan Stanley | 5.001 | (2.157) | iRhythm Technologies Inc | Morgan Stanley | 36.367 |
| (133) | Intuit Inc | Morgan Stanley | 804 | (1.742) | Iridium Communications Inc | Bank of America | |
| 687 | Intuitive Surgical Inc | HSBC | (584) | | | Merrill Lynch | 3.258 |
| 9.051 | InvenTrust Properties Corp (REIT) | Barclays Bank | (4.611) | (1.405) | Iridium Communications Inc | Barclays Bank | 2.711 |
| 46.281 | InvenTrust Properties Corp (REIT) | HSBC | (63.868) | 2.761 | Iridium Communications Inc | Barclays Bank | (5.329) |
| 10.318 | InvenTrust Properties Corp (REIT) | Morgan Stanley | (5.675) | (5.569) | Iron Mountain Inc (REIT) | Barclays Bank | 8.576 |
| 27.392 | Invesco Ltd | Bank of America | | 2.251 | Iron Mountain Inc (REIT) | Barclays Bank | (3.467) |
| | | Merrill Lynch | (19.448) | (6.437) | Iron Mountain Inc (REIT) | HSBC | 16.028 |
| 61.639 | Invesco Ltd | Barclays Bank | (41.672) | 67.898 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (3.734) |
| 71.777 | Invesco Ltd | Goldman Sachs | (50.962) | 25.383 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 6.727 |
| 56.989 | Invesco Ltd | HSBC | (43.847) | 17.191 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | HSBC | 4.899 |
| 48.611 | Invesco Ltd | Morgan Stanley | (28.867) | 21.912 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.205) |
| (17.543) | Invesco Mortgage Capital Inc (REIT) | Bank of America | | 2.657 | Ispire Technology Inc | Barclays Bank | (279) |
| | | Merrill Lynch | 3.684 | 5.597 | Ispire Technology Inc | Goldman Sachs | (5.439) |
| (20.710) | Invesco Mortgage Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | (1.243) | 2.436 | Ispire Technology Inc | HSBC | (4.291) |
| (13.049) | Invesco Mortgage Capital Inc (REIT) | HSBC | (5.089) | 2.801 | Ispire Technology Inc | Morgan Stanley | (294) |
| (34.209) | Invesco Mortgage Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | (2.053) | 12.739 | iTeos Therapeutics Inc | Barclays Bank | 10.956 |
| 10.705 | Investar Holding Corp | Barclays Bank | (3.104) | 9.158 | iTeos Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 11.905 |
| 10.254 | Investar Holding Corp | Goldman Sachs | (615) | 11.193 | iTeos Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 9.626 |
| 29.512 | Investar Holding Corp | HSBC | (33.053) | (44.244) | Iteris Inc | Bank of America | |
| 5.910 | Investar Holding Corp | Morgan Stanley | (1.714) | | | Merrill Lynch | 2.655 |
| 569 | Investors Title Co | Barclays Bank | (1.280) | (9.336) | Iteris Inc | Goldman Sachs | 560 |
| 4.811 | Investors Title Co | Goldman Sachs | (25.498) | (17.355) | Iteris Inc | Morgan Stanley | (3.297) |
| 861 | Investors Title Co | HSBC | (5.510) | (2.689) | Itron Inc | Goldman Sachs | (3.603) |
| 19.377 | Invitae Corp | Barclays Bank | (1.647) | 37.904 | ITT Inc | Barclays Bank | (217.190) |
| 13.579 | Invitae Corp | Goldman Sachs | (2.919) | 9.787 | ITT Inc | Goldman Sachs | (51.186) |
| 23.605 | Invitae Corp | HSBC | (13.809) | 7.636 | ITT Inc | HSBC | (52.765) |
| 5.053 | Invitae Corp | Morgan Stanley | (430) | 3.475 | ITT Inc | Morgan Stanley | (19.912) |
| 14.805 | Invitation Homes Inc (REIT) | Bank of America | | (1.344) | Ivanhoe Electric Inc | Goldman Sachs | 2.419 |
| | | Merrill Lynch | 9.422 | (30.150) | Ivanhoe Electric Inc | Morgan Stanley | 28.944 |
| 25.112 | Invitation Homes Inc (REIT) | Barclays Bank | 4.378 | (623) | J & J Snack Foods Corp | Bank of America | |
| 1.936 | Invitation Homes Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.611 | | | Merrill Lynch | 4.056 |
| | | | | (3.031) | J & J Snack Foods Corp | Barclays Bank | 8.426 |
| | | | | (307) | J & J Snack Foods Corp | Goldman Sachs | 1.999 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.643) | J & J Snack Foods Corp | HSBC | 29.020 | (3.043) | JB Hunt Transport Services Inc | HSBC | 31.979 |
| 3.527 | J Jill Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.232) | (5.042) | JB Hunt Transport Services Inc | Morgan Stanley | 8.143 |
| 6.529 | J Jill Inc | Barclays Bank | 2.873 | (13.107) | JBG SMITH Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 10.445 |
| 3.269 | J Jill Inc | HSBC | (1.067) | (44.245) | JBG SMITH Properties (REIT) | Barclays Bank | 51.767 |
| 7.972 | J Jill Inc | Morgan Stanley | 1.736 | (51.659) | JBG SMITH Properties (REIT) | Goldman Sachs | 26.862 |
| 6.531 | J M Smucker Co | Bank of America Merrill Lynch | (66.094) | (44.507) | JBG SMITH Properties (REIT) | HSBC | 9.347 |
| 8.111 | J M Smucker Co | Barclays Bank | (34.715) | (17.062) | JBG SMITH Properties (REIT) | Morgan Stanley | 19.963 |
| 7.637 | J M Smucker Co | Goldman Sachs | (77.286) | 17.323 | Jefferies Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 866 |
| 13.901 | J M Smucker Co | HSBC | (162.920) | 24.984 | Jefferies Financial Group Inc | Barclays Bank | (13.741) |
| 6.517 | J M Smucker Co | Morgan Stanley | (27.893) | 32.387 | Jefferies Financial Group Inc | HSBC | (972) |
| 693 | Jabil Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.089 | 34.561 | Jefferies Financial Group Inc | Morgan Stanley | (19.008) |
| 7.938 | Jabil Inc | Goldman Sachs | 81.206 | 22.136 | JELD-WEN Holding Inc | Barclays Bank | (29.583) |
| 13.537 | Jabil Inc | HSBC | 161.091 | 11.763 | JELD-WEN Holding Inc | Goldman Sachs | (12.822) |
| 11.434 | Jabil Inc | Morgan Stanley | 65.174 | 4.962 | JELD-WEN Holding Inc | HSBC | (5.394) |
| 1.545 | Jack Henry & Associates Inc | Bank of America Merrill Lynch | (589) | 4.251 | JELD-WEN Holding Inc | Morgan Stanley | (5.135) |
| 1.636 | Jack Henry & Associates Inc | Barclays Bank | (3.059) | 13.312 | JetBlue Airways Corp | Barclays Bank | (1.664) |
| (4.460) | Jack Henry & Associates Inc | Goldman Sachs | 27.830 | 132.159 | JetBlue Airways Corp | Goldman Sachs | (15.198) |
| (9.630) | Jack Henry & Associates Inc | HSBC | 54.795 | 150.632 | JetBlue Airways Corp | HSBC | (38.411) |
| 2.238 | Jack Henry & Associates Inc | HSBC | (11.203) | 22.273 | JetBlue Airways Corp | Morgan Stanley | (2.784) |
| 771 | Jack Henry & Associates Inc | Morgan Stanley | 1.803 | (25.404) | Joby Aviation Inc | Goldman Sachs | (19.307) |
| (6.481) | Jack in the Box Inc | Barclays Bank | 46.339 | (31.511) | Joby Aviation Inc | HSBC | (40.964) |
| (8.118) | Jackson Financial Inc 'A' | Barclays Bank | 14.775 | (67.267) | Joby Aviation Inc | Morgan Stanley | (14.799) |
| (4.872) | Jackson Financial Inc 'A' | Morgan Stanley | 8.867 | (290) | John B Sanfilippo & Son Inc | Bank of America Merrill Lynch | (925) |
| (16.753) | Jacobs Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 60.734 | (3.441) | John B Sanfilippo & Son Inc | Barclays Bank | (7.467) |
| (2.001) | Jacobs Solutions Inc | Barclays Bank | 9.768 | (4.213) | John B Sanfilippo & Son Inc | Morgan Stanley | (9.142) |
| (3.987) | Jacobs Solutions Inc | Goldman Sachs | 14.513 | 6.631 | John Bean Technologies Corp | Goldman Sachs | 26.922 |
| (3.651) | Jacobs Solutions Inc | HSBC | 27.344 | 2.081 | John Bean Technologies Corp | HSBC | 7.055 |
| (3.861) | Jacobs Solutions Inc | Morgan Stanley | 25.435 | 5.061 | John Bean Technologies Corp | Morgan Stanley | 19.282 |
| 973 | JAKKS Pacific Inc | Barclays Bank | (3.298) | (8.479) | John Marshall Bancorp Inc | Barclays Bank | (8.394) |
| 3.594 | JAKKS Pacific Inc | HSBC | (9.812) | (8.312) | John Marshall Bancorp Inc | HSBC | (33.830) |
| 1.250 | JAKKS Pacific Inc | Morgan Stanley | (4.238) | (4.788) | John Marshall Bancorp Inc | Morgan Stanley | (4.740) |
| 13.439 | Jamf Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9.676 | (12.451) | John Wiley & Sons Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (6.226) |
| 5.408 | Jamf Holding Corp | Barclays Bank | (1.839) | (18.538) | John Wiley & Sons Inc 'A' | Barclays Bank | 14.830 |
| 14.826 | Jamf Holding Corp | Goldman Sachs | 10.675 | (6.762) | John Wiley & Sons Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.381) |
| 3.985 | Jamf Holding Corp | HSBC | (598) | (9.863) | John Wiley & Sons Inc 'A' | HSBC | (5.721) |
| 6.059 | Jamf Holding Corp | Morgan Stanley | (2.060) | (10.094) | John Wiley & Sons Inc 'A' | Morgan Stanley | 8.075 |
| (7.768) | Janus Henderson Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (888) | 4.462 | Johnson & Johnson | Barclays Bank | (12.538) |
| (35.269) | Janus Henderson Group Plc | Barclays Bank | 22.572 | 5.770 | Johnson Controls International Plc | Barclays Bank | (13.675) |
| (31.020) | Janus Henderson Group Plc | Goldman Sachs | (1.241) | 8.521 | Johnson Controls International Plc | Goldman Sachs | (15.253) |
| (11.223) | Janus Henderson Group Plc | HSBC | 5.499 | 3.548 | Johnson Controls International Plc | HSBC | (8.728) |
| (7.162) | Janus Henderson Group Plc | Morgan Stanley | 4.584 | 10.938 | Johnson Controls International Plc | Morgan Stanley | (25.923) |
| 24.898 | Janus International Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (10.473) | (2.290) | Johnson Outdoors Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 5.382 |
| 17.201 | Janus International Group Inc | Barclays Bank | (7.468) | (2.278) | Johnson Outdoors Inc 'A' | Barclays Bank | 2.916 |
| 36.846 | Janus International Group Inc | Goldman Sachs | (10.742) | (2.890) | Johnson Outdoors Inc 'A' | Goldman Sachs | 6.792 |
| 34.110 | Janus International Group Inc | HSBC | (13.964) | (2.456) | Johnson Outdoors Inc 'A' | HSBC | 884 |
| 48.641 | Janus International Group Inc | Morgan Stanley | (22.375) | (4.604) | Johnson Outdoors Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.893 |
| 1.698 | Janux Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 684 | 1.655 | Joint Corp | Bank of America Merrill Lynch | (66) |
| 2.272 | Jazz Pharmaceuticals Plc | Barclays Bank | (15.245) | 4.375 | Joint Corp | Barclays Bank | (1.050) |
| (1.709) | Jazz Pharmaceuticals Plc | Barclays Bank | 11.467 | | | | |
| 1.997 | Jazz Pharmaceuticals Plc | HSBC | (13.860) | | | | |
| (10.204) | JB Hunt Transport Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 82.745 | | | | |
| (2.544) | JB Hunt Transport Services Inc | Barclays Bank | 4.108 | | | | |
| (314) | JB Hunt Transport Services Inc | Goldman Sachs | 2.608 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 9.305 | Joint Corp | Goldman Sachs | (372) | (14.630) | Kearny Financial Corp | Morgan Stanley | 1.756 |
| 2.666 | Joint Corp | HSBC | (1.186) | 18.276 | Kellogg Co | Bank of America | |
| 2.487 | Joint Corp | Morgan Stanley | (597) | | | Merrill Lynch | (76.759) |
| (6.860) | Jones Lang LaSalle Inc | Bank of America | | 53.661 | Kellogg Co | Barclays Bank | (129.859) |
| | | Merrill Lynch | (707) | 18.274 | Kellogg Co | HSBC | (95.208) |
| (4.168) | Jones Lang LaSalle Inc | Barclays Bank | 16.988 | 8.396 | Kelly Services Inc 'A' | Bank of America | |
| (1.518) | Jones Lang LaSalle Inc | Goldman Sachs | (2.766) | | | Merrill Lynch | (5.373) |
| (4.514) | Jones Lang LaSalle Inc | HSBC | (8.941) | 547 | Kelly Services Inc 'A' | Barclays Bank | (678) |
| (1.609) | Jones Lang LaSalle Inc | Morgan Stanley | 6.059 | 24.735 | Kelly Services Inc 'A' | HSBC | 43.039 |
| (10.380) | JPMorgan Chase & Co | Barclays Bank | 28.649 | 2.200 | Kemper Corp | Bank of America | |
| (27.908) | JPMorgan Chase & Co | Morgan Stanley | 77.026 | | | Merrill Lynch | (2.530) |
| (4.034) | Juniper Networks Inc | Bank of America | | 992 | Kemper Corp | Goldman Sachs | (1.141) |
| | | Merrill Lynch | (2.254) | 1.715 | Kemper Corp | HSBC | (5.488) |
| 70.306 | Juniper Networks Inc | Barclays Bank | 46.402 | 2.705 | Kemper Corp | Morgan Stanley | (4.139) |
| (2.556) | Juniper Networks Inc | Barclays Bank | (1.687) | 1.390 | Kennametal Inc | Bank of America | |
| 75.062 | Juniper Networks Inc | Goldman Sachs | 84.820 | | | Merrill Lynch | (1.321) |
| (20.344) | Juniper Networks Inc | Goldman Sachs | (20.454) | 36.186 | Kennametal Inc | Barclays Bank | (58.983) |
| 11.036 | Juniper Networks Inc | HSBC | 16.775 | 2.208 | Kennametal Inc | Goldman Sachs | (2.098) |
| (5.885) | Juniper Networks Inc | HSBC | (8.871) | 4.339 | Kennametal Inc | HSBC | (8.895) |
| (21.356) | Juniper Networks Inc | Morgan Stanley | (14.392) | 5.277 | Kennametal Inc | Morgan Stanley | (8.602) |
| 562 | Kadant Inc | Bank of America | | (9.371) | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (4.732) | (37.730) | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Merrill Lynch | (9.184) |
| 3.000 | Kadant Inc | Barclays Bank | (32.670) | | | Barclays Bank | 1.887 |
| 3.033 | Kadant Inc | Goldman Sachs | (25.538) | (5.619) | Kennedy-Wilson Holdings Inc | HSBC | (3.225) |
| 1.901 | Kadant Inc | HSBC | (13.155) | (29.359) | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.305 |
| 2.796 | Kadant Inc | Morgan Stanley | (30.448) | (398) | Keros Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 8.249 | Kaiser Aluminum Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (525) |
| | | Merrill Lynch | 4.619 | (949) | Keros Therapeutics Inc | Barclays Bank | 622 |
| 1.083 | Kaiser Aluminum Corp | Goldman Sachs | 606 | (4.447) | Keros Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (5.870) |
| 2.152 | Kaiser Aluminum Corp | HSBC | (2.604) | (1.064) | Keros Therapeutics Inc | HSBC | (5.496) |
| 2.279 | Kaiser Aluminum Corp | Morgan Stanley | (7.931) | (819) | Keros Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 536 |
| 4.816 | Kaleyra Inc | Barclays Bank | 3.660 | 10.743 | Keurig Dr Pepper Inc | Bank of America | |
| (5.362) | KalVista Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 3.700 | | | Merrill Lynch | (16.007) |
| (4.261) | Kaman Corp | Bank of America | | 35.188 | Keurig Dr Pepper Inc | Barclays Bank | (36.595) |
| | | Merrill Lynch | 3.579 | 35.792 | Keurig Dr Pepper Inc | HSBC | (70.868) |
| (12.957) | Kaman Corp | Barclays Bank | 18.399 | 37.415 | Keurig Dr Pepper Inc | Morgan Stanley | (38.912) |
| (12.136) | Kaman Corp | Goldman Sachs | 10.194 | 7.430 | Key Tronic Corp | Bank of America | |
| (3.683) | Kaman Corp | HSBC | 2.283 | | | Merrill Lynch | (2.601) |
| (6.062) | Kaman Corp | Morgan Stanley | 8.608 | 55.656 | KeyCorp | Bank of America | |
| 34.705 | Karat Packaging Inc | Barclays Bank | (4.512) | | | Merrill Lynch | 4.452 |
| 5.240 | Karat Packaging Inc | Goldman Sachs | (838) | 203.807 | KeyCorp | Barclays Bank | (124.322) |
| 8.602 | Karat Packaging Inc | Morgan Stanley | (1.118) | 164.367 | KeyCorp | Goldman Sachs | 13.149 |
| (3.668) | Karuna Therapeutics Inc | Barclays Bank | 13.829 | 165.821 | KeyCorp | HSBC | (1.658) |
| (6.238) | Karuna Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 53.273 | 147.256 | KeyCorp | Morgan Stanley | (89.826) |
| (8.670) | Karuna Therapeutics Inc | HSBC | (51.847) | 3.662 | Keysight Technologies Inc | Bank of America | |
| (288) | Karuna Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.086 | | | Merrill Lynch | 51.305 |
| 40.055 | Karyopharm Therapeutics Inc | Barclays Bank | (11.215) | 6.162 | Keysight Technologies Inc | Barclays Bank | 25.203 |
| 10.518 | Karyopharm Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.419) | 9.816 | Keysight Technologies Inc | Goldman Sachs | 137.522 |
| | | HSBC | (1.912) | 2.144 | Keysight Technologies Inc | Morgan Stanley | 8.769 |
| 7.649 | Karyopharm Therapeutics Inc | Barclays Bank | 13.028 | (18.478) | Kezar Life Sciences Inc | Goldman Sachs | 2.310 |
| (40.710) | KB Home | Goldman Sachs | 10.094 | (4.292) | Kezar Life Sciences Inc | HSBC | (1.052) |
| (5.516) | KB Home | HSBC | 26.201 | 6.926 | Kforce Inc | Barclays Bank | (11.082) |
| (27.580) | KB Home | Bank of America | | 7.011 | Kforce Inc | Goldman Sachs | 9.535 |
| (1.537) | KBR Inc | Merrill Lynch | 1.122 | 4.262 | Kforce Inc | Morgan Stanley | (6.819) |
| | | Barclays Bank | 961 | 759 | Kilroy Realty Corp (REIT) | Bank of America | |
| (2.090) | KBR Inc | Barclays Bank | (2.156) | | | Merrill Lynch | (68) |
| 4.686 | KBR Inc | Goldman Sachs | (4.435) | 39.229 | Kilroy Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (7.845) |
| 6.075 | KBR Inc | Goldman Sachs | 1.349 | 23.799 | Kilroy Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (2.142) |
| (1.848) | KBR Inc | HSBC | 1.705 | 33.575 | Kilroy Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | (6.715) |
| (13.950) | KBR Inc | HSBC | 3.506 | (6.749) | Kimball Electronics Inc | Goldman Sachs | (18.897) |
| 26.971 | KBR Inc | Morgan Stanley | 224 | (17.288) | Kimball International Inc 'B' | Bank of America | |
| (487) | KBR Inc | Barclays Bank | (1.195) | | | Merrill Lynch | 2.939 |
| (8.539) | Kearny Financial Corp | Barclays Bank | (1.195) | (26.048) | Kimball International Inc 'B' | Barclays Bank | 2.344 |
| | | Merrill Lynch | 19.399 | (11.197) | Kimball International Inc 'B' | HSBC | 1.120 |
| (161.657) | Kearny Financial Corp | Goldman Sachs | (12.102) | (45.057) | Kimball International Inc 'B' | Morgan Stanley | 4.055 |
| (86.444) | Kearny Financial Corp | HSBC | 486 | 12.513 | Kimberly-Clark Corp | Bank of America | |
| (2.313) | Kearny Financial Corp | | | | | Merrill Lynch | (123.331) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 36.599 | Kimberly-Clark Corp | Barclays Bank | (286.937) | (321) | KLA Corp | Morgan Stanley | (9.675) |
| 1.831 | Kimberly-Clark Corp | Goldman Sachs | (20.123) | (20.979) | KLX Energy Services Holdings Inc | Bank of America | |
| 6.373 | Kimberly-Clark Corp | HSBC | (75.711) | | | Merrill Lynch | 53.287 |
| 14.869 | Kimberly-Clark Corp | Morgan Stanley | (99.518) | (14.261) | KLX Energy Services Holdings Inc | Barclays Bank | 30.233 |
| 14.187 | Kimco Realty Corp (REIT) | Bank of America | | (1.242) | KLX Energy Services Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.155 |
| | | Merrill Lynch | (8.938) | | | | |
| 171.178 | Kimco Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | (123.248) | (2.035) | KLX Energy Services Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.314 |
| 103.664 | Kimco Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (65.308) | 3.209 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Bank of America | |
| 77.597 | Kimco Realty Corp (REIT) | HSBC | (34.143) | | | Merrill Lynch | (4.236) |
| 85.533 | Kimco Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | (61.584) | 2.241 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Barclays Bank | (579) |
| (72.876) | Kinder Morgan Inc | Bank of America | | 14.796 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | HSBC | (22.027) |
| | | Merrill Lynch | 42.997 | (4.352) | Knowles Corp | Bank of America | |
| (46.738) | Kinder Morgan Inc | Barclays Bank | 19.630 | | | Merrill Lynch | (7.311) |
| (39.135) | Kinder Morgan Inc | Goldman Sachs | 23.090 | (16.975) | Knowles Corp | Barclays Bank | (24.784) |
| (160.398) | Kinder Morgan Inc | HSBC | 126.714 | (25.309) | Knowles Corp | HSBC | (58.717) |
| (21.871) | Kinder Morgan Inc | Morgan Stanley | 9.186 | (1.265) | Knowles Corp | Morgan Stanley | (1.847) |
| (15.776) | Kinetik Holdings Inc | Bank of America | | 27.245 | Kodiak Sciences Inc | Barclays Bank | (31.332) |
| | | Merrill Lynch | (8.408) | 3.740 | Kodiak Sciences Inc | Goldman Sachs | 1.459 |
| (17.031) | Kinetik Holdings Inc | Barclays Bank | (341) | 21.825 | Kodiak Sciences Inc | HSBC | 17.242 |
| (5.366) | Kinetik Holdings Inc | Goldman Sachs | (3.381) | 7.322 | Kodiak Sciences Inc | Morgan Stanley | (8.420) |
| (29.278) | Kinetik Holdings Inc | Morgan Stanley | (830) | (12.498) | Kohl's Corp | Bank of America | |
| 15.440 | Kiniksa Pharmaceuticals Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.934) | | | Merrill Lynch | 21.871 |
| 14.185 | Kinnate Biopharma Inc | Barclays Bank | (3.830) | (11.467) | Kohl's Corp | Barclays Bank | 9.747 |
| 6.656 | Kinnate Biopharma Inc | Goldman Sachs | (3.328) | (23.420) | Kohl's Corp | HSBC | 42.156 |
| 5.764 | Kinnate Biopharma Inc | HSBC | 3.862 | (3.896) | Kohl's Corp | Morgan Stanley | 3.312 |
| 949 | Kinsale Capital Group Inc | Bank of America | | 6.989 | Kontoor Brands Inc | Barclays Bank | (6.500) |
| | | Merrill Lynch | (14.824) | (6.584) | Koppers Holdings Inc | Barclays Bank | 17.908 |
| 3.027 | Kinsale Capital Group Inc | Barclays Bank | (32.843) | (20.635) | Koppers Holdings Inc | Goldman Sachs | 47.873 |
| (599) | Kinsale Capital Group Inc | Barclays Bank | 6.499 | (663) | Koppers Holdings Inc | HSBC | 2.071 |
| 1.140 | Kinsale Capital Group Inc | Goldman Sachs | (22.846) | (1.030) | Koppers Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.802 |
| 640 | Kinsale Capital Group Inc | HSBC | (1.746) | 5.280 | KORE Group Holdings Inc | Barclays Bank | (211) |
| (109) | Kinsale Capital Group Inc | HSBC | 2.223 | 14.530 | KORE Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.051 |
| 993 | Kinsale Capital Group Inc | Morgan Stanley | (9.402) | 15.656 | KORE Group Holdings Inc | HSBC | 7.358 |
| (3.452) | Kirby Corp | Barclays Bank | 3.789 | 4.626 | KORE Group Holdings Inc | Morgan Stanley | (185) |
| (2.904) | Kirby Corp | Goldman Sachs | 1.016 | (2.322) | Korn Ferry | Barclays Bank | 4.296 |
| (1.971) | Kirby Corp | HSBC | 2.364 | (15.264) | Korn Ferry | Goldman Sachs | 2.290 |
| 1.176 | Kirby Corp | Morgan Stanley | (1.705) | (7.024) | Korn Ferry | HSBC | (3.933) |
| (8.597) | Kirkland's Inc | Bank of America | | (49.825) | KORU Medical Systems Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 860 | | | Merrill Lynch | 16.442 |
| (18.592) | Kirkland's Inc | Barclays Bank | 3.347 | (3.548) | KORU Medical Systems Inc | Morgan Stanley | 674 |
| (917) | Kirkland's Inc | Goldman Sachs | 92 | (3.582) | Kosmos Energy Ltd | Bank of America | |
| (7.332) | Kirkland's Inc | HSBC | 587 | | | Merrill Lynch | 1.995 |
| (16.697) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Bank of America | | (54.827) | Kosmos Energy Ltd | Barclays Bank | 27.452 |
| | | Merrill Lynch | 25.379 | (5.430) | Kosmos Energy Ltd | Goldman Sachs | 570 |
| 29.975 | Kite Realty Group Trust (REIT) | Bank of America | | (23.430) | Kosmos Energy Ltd | HSBC | 2.737 |
| | | Merrill Lynch | (45.562) | (22.410) | Kosmos Energy Ltd | Morgan Stanley | 9.665 |
| (55.789) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Barclays Bank | 66.947 | (12.893) | Kraft Heinz Co | Bank of America | |
| 29.650 | Kite Realty Group Trust (REIT) | Barclays Bank | (35.580) | (11.795) | Kraft Heinz Co | Merrill Lynch | 30.299 |
| (58.425) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Goldman Sachs | 88.806 | 8.953 | Kraft Heinz Co | Barclays Bank | 10.851 |
| 18.568 | Kite Realty Group Trust (REIT) | Goldman Sachs | (28.223) | (29.333) | Kraft Heinz Co | Barclays Bank | (8.237) |
| (3.632) | Kite Realty Group Trust (REIT) | HSBC | 5.230 | 1.997 | Kraft Heinz Co | Goldman Sachs | 68.933 |
| 38.933 | Kite Realty Group Trust (REIT) | HSBC | (56.064) | (74.173) | Kraft Heinz Co | Goldman Sachs | (4.693) |
| (6.959) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Morgan Stanley | 6.558 | (16.142) | Kraft Heinz Co | HSBC | 241.804 |
| (25.613) | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (4.354) | 46.883 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Morgan Stanley | 14.851 |
| (38.994) | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (30.415) | (13.148) | Krispy Kreme Inc | HSBC | (1.875) |
| (20.688) | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | HSBC | (21.102) | (47.600) | Krispy Kreme Inc | Bank of America | 1.306 |
| 1.833 | KLA Corp | Barclays Bank | 55.247 | (55.325) | Krispy Kreme Inc | Merrill Lynch | 1.306 |
| (877) | KLA Corp | HSBC | (52.871) | (2.783) | Kroger Co | HSBC | (2.042) |
| 675 | KLA Corp | Morgan Stanley | 20.344 | 14.115 | Kroger Co | Morgan Stanley | 30.118 |
| | | | | (4.085) | Kroger Co | Bank of America | |
| | | | | (9.776) | Kroger Co | Merrill Lynch | 9.796 |
| | | | | (3.443) | Kroger Co | Barclays Bank | (62.529) |
| | | | | | | Barclays Bank | 16.317 |
| | | | | | | Goldman Sachs | 34.931 |
| | | | | | | HSBC | 12.402 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.183 | Kroger Co | Morgan Stanley | (5.241) | 95.763 | Ladder Capital Corp (REIT) | HSBC | 37.348 |
| 2.872 | Kronos Bio Inc | Bank of America | | 5.225 | Ladder Capital Corp (REIT) | Morgan Stanley | (627) |
| | | Merrill Lynch | (919) | 3.479 | Lakeland Bancorp Inc | Bank of America | |
| 16.128 | Kronos Bio Inc | Barclays Bank | (4.838) | | | Merrill Lynch | 2.679 |
| 14.669 | Kronos Bio Inc | Goldman Sachs | (4.694) | 53.752 | Lakeland Bancorp Inc | Barclays Bank | (12.900) |
| 35.744 | Kronos Bio Inc | HSBC | (13.225) | 4.279 | Lakeland Bancorp Inc | Goldman Sachs | 3.295 |
| 37.219 | Kronos Bio Inc | Morgan Stanley | (11.166) | 40.930 | Lakeland Bancorp Inc | HSBC | 31.516 |
| (26.342) | Kronos Worldwide Inc | Bank of America | | 9.913 | Lakeland Bancorp Inc | Morgan Stanley | (2.379) |
| | | Merrill Lynch | (10.537) | (349) | Lakeland Financial Corp | Bank of America | |
| (30.835) | Kronos Worldwide Inc | Barclays Bank | 10.176 | | | Merrill Lynch | (2.673) |
| (10.285) | Kronos Worldwide Inc | Goldman Sachs | (4.114) | (10.852) | Lakeland Financial Corp | Barclays Bank | (10.309) |
| (8.108) | Kronos Worldwide Inc | HSBC | 162 | (2.099) | Lakeland Financial Corp | Morgan Stanley | (1.994) |
| (6.939) | Kronos Worldwide Inc | Morgan Stanley | 2.290 | (29.422) | Lakeland Industries Inc | Barclays Bank | (736) |
| (905) | Krystal Biotech Inc | Barclays Bank | 1.647 | 383 | Lam Research Corp | Barclays Bank | 15.737 |
| (5.319) | Krystal Biotech Inc | HSBC | (135.425) | 40 | Lam Research Corp | Goldman Sachs | (152) |
| (3.662) | Kulicke & Soffa Industries Inc | | | 96 | Lam Research Corp | HSBC | 9.540 |
| | | Barclays Bank | (6.592) | 627 | Lam Research Corp | Morgan Stanley | 25.763 |
| (5.300) | Kulicke & Soffa Industries Inc | | | 313 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | (25.122) | | | Merrill Lynch | (1.653) |
| 12.691 | Kura Oncology Inc | Bank of America | | 2.763 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | | |
| | | Merrill Lynch | 9.391 | | | Barclays Bank | (11.660) |
| 12.561 | Kura Oncology Inc | Barclays Bank | 126 | 2.636 | Lamar Advertising Co 'A' (REIT) | | |
| 16.620 | Kura Oncology Inc | Goldman Sachs | 12.299 | | | Goldman Sachs | (13.918) |
| 6.994 | Kura Oncology Inc | HSBC | 15.457 | (1.608) | Lamb Weston Holdings Inc | Bank of America | |
| (138) | Kura Sushi USA Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 6.799 |
| | | Merrill Lynch | (2.343) | (13.954) | Lamb Weston Holdings Inc | Barclays Bank | 26.791 |
| (3.316) | Kura Sushi USA Inc 'A' | Barclays Bank | (40.157) | (684) | Lamb Weston Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.777 |
| (2.309) | Kura Sushi USA Inc 'A' | HSBC | (44.056) | (14.310) | Lamb Weston Holdings Inc | HSBC | 34.409 |
| 3.795 | KVH Industries Inc | Bank of America | | (12.520) | Lamb Weston Holdings Inc | Morgan Stanley | 24.038 |
| | | Merrill Lynch | (1.746) | 1.787 | Lancaster Colony Corp | Bank of America | |
| 30.118 | KVH Industries Inc | Barclays Bank | (14.457) | | | Merrill Lynch | (25.322) |
| 13.245 | KVH Industries Inc | Morgan Stanley | (6.358) | (4.399) | Lancaster Colony Corp | Barclays Bank | 27.406 |
| 2.476 | Kymera Therapeutics Inc | Bank of America | | 4.740 | Lancaster Colony Corp | Barclays Bank | (29.530) |
| | | Merrill Lynch | (2.080) | 966 | Lancaster Colony Corp | Goldman Sachs | (13.688) |
| 630 | Kymera Therapeutics Inc | Barclays Bank | (365) | 1.115 | Lancaster Colony Corp | HSBC | (21.252) |
| 1.541 | Kymera Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.294) | 1.059 | Lancaster Colony Corp | Morgan Stanley | (6.598) |
| 1.374 | Kymera Therapeutics Inc | HSBC | 1.814 | (7.574) | Landmark Bancorp Inc | Bank of America | |
| 1.454 | Kymera Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (843) | | | Merrill Lynch | (3.257) |
| (901) | Kyndryl Holdings Inc | Bank of America | | (13.309) | Landmark Bancorp Inc | Goldman Sachs | (5.723) |
| | | Merrill Lynch | 1.685 | (10.256) | Lands' End Inc | Bank of America | |
| 2.900 | Kyndryl Holdings Inc | Barclays Bank | (49) | | | Merrill Lynch | 14.153 |
| 6.789 | Kyndryl Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.415 | (8.755) | Lands' End Inc | Goldman Sachs | 12.082 |
| 25.746 | Kyndryl Holdings Inc | HSBC | 9.861 | (2.066) | Lands' End Inc | Morgan Stanley | 3.430 |
| (7.798) | Kyndryl Holdings Inc | HSBC | 12.945 | 16.919 | Landsea Homes Corp | Barclays Bank | 2.707 |
| (6.049) | Kyndryl Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.085) | 4.886 | Landsea Homes Corp | Goldman Sachs | 3.371 |
| 19.929 | L B Foster Co 'A' | Bank of America | | 10.651 | Landsea Homes Corp | HSBC | 12.781 |
| | | Merrill Lynch | 49.424 | 2.510 | Landsea Homes Corp | Morgan Stanley | 402 |
| 8.345 | L B Foster Co 'A' | Barclays Bank | 3.338 | 1.054 | Landstar System Inc | Bank of America | |
| 14.201 | L B Foster Co 'A' | Goldman Sachs | 35.218 | | | Merrill Lynch | (2.793) |
| 10.894 | L B Foster Co 'A' | Morgan Stanley | 4.358 | 6.288 | Landstar System Inc | Barclays Bank | (88) |
| 335 | Laboratory Corp of America Holdings | Bank of America | | 9.038 | Landstar System Inc | Goldman Sachs | (23.950) |
| | | Merrill Lynch | (4.459) | 1.534 | Landstar System Inc | HSBC | (6.378) |
| (2.142) | Laboratory Corp of America Holdings | | | 1.539 | Landstar System Inc | Morgan Stanley | (249) |
| 729 | Laboratory Corp of America Holdings | Barclays Bank | 17.986 | (700) | Lantheus Holdings Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 8.056 |
| (4.061) | Laboratory Corp of America Holdings | Barclays Bank | (6.583) | (4.607) | Lantheus Holdings Inc | Barclays Bank | 55.192 |
| 78 | Laboratory Corp of America Holdings | Goldman Sachs | 54.052 | (1.675) | Lantheus Holdings Inc | Goldman Sachs | 21.557 |
| | | | | 4.370 | Lantronix Inc | HSBC | 3.278 |
| (2.537) | Laboratory Corp of America Holdings | Goldman Sachs | (1.038) | 649 | Las Vegas Sands Corp | Bank of America | |
| 2.153 | Laboratory Corp of America Holdings | HSBC | 32.930 | (24.578) | Las Vegas Sands Corp | Merrill Lynch | (3.466) |
| (3.077) | Laboratory Corp of America Holdings | HSBC | (27.946) | 1.383 | Las Vegas Sands Corp | Barclays Bank | 119.941 |
| 2.217 | Laboratory Corp of America Holdings | Morgan Stanley | 27.785 | (31.572) | Latch Inc | Barclays Bank | (6.749) |
| | | | | (7.070) | Latch Inc | Barclays Bank | 947 |
| 90.362 | Ladder Capital Corp (REIT) | Morgan Stanley | (20.020) | (8.106) | Latch Inc | HSBC | (1.626) |
| 101.380 | Ladder Capital Corp (REIT) | Barclays Bank | (10.843) | (5.644) | Latham Group Inc | Morgan Stanley | 243 |
| | | Goldman Sachs | 29.400 | | | Bank of America | |
| | | | | (9.345) | Latham Group Inc | Merrill Lynch | (508) |
| | | | | (24.347) | Latham Group Inc | Barclays Bank | (2.523) |
| | | | | (10.083) | Latham Group Inc | Goldman Sachs | (2.191) |
| | | | | | | HSBC | (12.402) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 6.264 | Lattice Semiconductor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6.640) | 1.410 | LendingTree Inc | Bank of America Merrill Lynch | 498 |
| 31.350 | Lattice Semiconductor Corp | Barclays Bank | (31.760) | 9.356 | LendingTree Inc | Barclays Bank | (14.315) |
| 27.808 | Lattice Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (26.850) | 8.094 | LendingTree Inc | Goldman Sachs | 2.763 |
| 12.473 | Lattice Semiconductor Corp | HSBC | (19.539) | 897 | LendingTree Inc | HSBC | (1.217) |
| 5.584 | Lattice Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (6.087) | 1.158 | LendingTree Inc | Morgan Stanley | 14 |
| 12.588 | Laureate Education Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.077 | (885) | Lennar Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 5.452 |
| 13.714 | Laureate Education Inc | Barclays Bank | (1.440) | (9.160) | Lennar Corp 'A' | Barclays Bank | 30.778 |
| 88.520 | Laureate Education Inc | Goldman Sachs | 14.606 | (2.591) | Lennar Corp 'A' | HSBC | 18.918 |
| 27.478 | Laureate Education Inc | HSBC | 5.633 | (2.750) | Lennar Corp 'A' | Morgan Stanley | 9.240 |
| 8.781 | La-Z-Boy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11.415) | 2.462 | Lennox International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (19.844) |
| 26.481 | La-Z-Boy Inc | Barclays Bank | (9.004) | 3.143 | Lennox International Inc | Barclays Bank | (7.826) |
| 18.575 | La-Z-Boy Inc | Goldman Sachs | (24.148) | (487) | Lennox International Inc | Barclays Bank | 1.213 |
| 9.276 | La-Z-Boy Inc | HSBC | (12.615) | 828 | Lennox International Inc | Goldman Sachs | (6.674) |
| 14.147 | La-Z-Boy Inc | Morgan Stanley | (4.810) | (107) | Lennox International Inc | HSBC | 378 |
| (14.698) | Lazydays Holdings Inc | Goldman Sachs | (8.084) | (22.250) | LENSAR Inc | Bank of America Merrill Lynch | (20.470) |
| (1.580) | Lazydays Holdings Inc | Morgan Stanley | (600) | (586) | LENSAR Inc | Barclays Bank | (234) |
| (1.008) | LCI Industries | Bank of America Merrill Lynch | 2.789 | (1.462) | LENSAR Inc | Goldman Sachs | (1.345) |
| (2.054) | LCI Industries | Barclays Bank | 8.148 | (7.457) | LENSAR Inc | HSBC | (3.654) |
| (2.852) | LCI Industries | Goldman Sachs | 8.043 | (10.755) | LENSAR Inc | Morgan Stanley | (4.302) |
| (6.056) | LCI Industries | HSBC | 29.838 | (13.046) | Leslie's Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17.155 |
| (3.481) | LCI Industries | Morgan Stanley | 9.473 | (12.696) | Leslie's Inc | Barclays Bank | 11.998 |
| 3.107 | LCNB Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.101) | (46.569) | Leslie's Inc | Goldman Sachs | 61.238 |
| 11.046 | LCNB Corp | Barclays Bank | (6.186) | (38.566) | Leslie's Inc | HSBC | 68.840 |
| 4.185 | LCNB Corp | Goldman Sachs | (5.524) | (32.342) | Leslie's Inc | Morgan Stanley | 30.563 |
| 4.094 | LCNB Corp | HSBC | (2.866) | 7.915 | Leslie's Inc | Morgan Stanley | (706) |
| 7.441 | LCNB Corp | Morgan Stanley | (4.167) | (2.184) | Levi Strauss & Co 'A' | Goldman Sachs | 939 |
| 5.872 | Lear Corp | Barclays Bank | (16.676) | (13.007) | Levi Strauss & Co 'A' | HSBC | 8.443 |
| 4.207 | Lear Corp | Goldman Sachs | 2.356 | (7.500) | Levi Strauss & Co 'A' | Morgan Stanley | (600) |
| 12.822 | Lear Corp | HSBC | (52.955) | (3.374) | Lexicon Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 135 |
| (634) | Lear Corp | HSBC | 2.819 | (2.606) | Lexicon Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 704 |
| 8.480 | Lear Corp | Morgan Stanley | (24.083) | (22.877) | Lexicon Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 915 |
| 1.942 | Lee Enterprises Inc | Barclays Bank | 1.602 | (16.282) | Lexicon Pharmaceuticals Inc | HSBC | 5.210 |
| 2.167 | Lee Enterprises Inc | Goldman Sachs | 3.001 | (6.000) | Lexicon Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 1.620 |
| 1.696 | Lee Enterprises Inc | HSBC | 4.622 | (4.237) | LGI Homes Inc | Bank of America Merrill Lynch | 14.088 |
| 950 | Lee Enterprises Inc | Morgan Stanley | 784 | (8.856) | LGI Homes Inc | Barclays Bank | 30.553 |
| (3.116) | Legacy Housing Corp | Bank of America Merrill Lynch | 7.131 | (6.654) | LGI Homes Inc | Goldman Sachs | 22.124 |
| (5.967) | Legacy Housing Corp | Barclays Bank | 12.232 | (8.810) | LGI Homes Inc | HSBC | 5.991 |
| (4.267) | Legacy Housing Corp | Goldman Sachs | 13.868 | 4.126 | Liberty Broadband Corp 'A' | Goldman Sachs | (11.800) |
| (8.619) | Legacy Housing Corp | HSBC | 24.433 | 1.082 | Liberty Broadband Corp 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (3.419) |
| (894) | Legacy Housing Corp | Morgan Stanley | 1.833 | 1.536 | Liberty Broadband Corp 'C' | HSBC | (2.718) |
| (14.655) | Legalzoom.com Inc | Barclays Bank | (3.810) | 490 | Liberty Broadband Corp 'C' | Morgan Stanley | (1.367) |
| (1.699) | Leggett & Platt Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.347 | 26.185 | Liberty Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.376) |
| (26.136) | Leggett & Platt Inc | Barclays Bank | 52.795 | 34.635 | Liberty Energy Inc | Barclays Bank | (39.138) |
| (30.187) | Leggett & Platt Inc | Goldman Sachs | 59.469 | 20.547 | Liberty Energy Inc | Goldman Sachs | (4.931) |
| (58.376) | Leggett & Platt Inc | HSBC | 132.514 | 63.864 | Liberty Energy Inc | HSBC | (15.827) |
| (8.627) | Leggett & Platt Inc | Morgan Stanley | 17.427 | 50.994 | Liberty Global Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (60.683) |
| 1.409 | Leidos Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 902 | 51.007 | Liberty Global Plc 'A' | Barclays Bank | (34.685) |
| 1.874 | Leidos Holdings Inc | Barclays Bank | (1.968) | 1.357 | Liberty Global Plc 'A' | Goldman Sachs | (1.615) |
| (1.737) | Leidos Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.112) | 47.204 | Liberty Global Plc 'A' | HSBC | (126.035) |
| 2.347 | Leidos Holdings Inc | Goldman Sachs | 960 | 144.340 | Liberty Global Plc 'A' | Morgan Stanley | (98.151) |
| 1.198 | Leidos Holdings Inc | HSBC | 2.434 | 18.664 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (16.051) |
| 1.392 | Leidos Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.462) | 5.113 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Barclays Bank | (3.630) |
| (7.341) | LeMaitre Vascular Inc | Barclays Bank | (1.909) | 52.190 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Goldman Sachs | (44.883) |
| (9.398) | LeMaitre Vascular Inc | Goldman Sachs | 19.548 | 10.095 | Liberty Latin America Ltd 'A' | HSBC | (9.691) |
| (779) | LeMaitre Vascular Inc | HSBC | 3.443 | 14.528 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Morgan Stanley | (10.315) |
| 1.967 | Lemonade Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.055 | | | | |
| 4.117 | Lemonade Inc | Goldman Sachs | 10.581 | | | | |
| 9.427 | LendingClub Corp | Bank of America Merrill Lynch | 7.353 | | | | |
| 50.425 | LendingClub Corp | Barclays Bank | 5.043 | | | | |
| 8.525 | LendingClub Corp | Goldman Sachs | 6.650 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 10.399 | Liberty Latin America Ltd 'C' | Bank of America | | (13.007) | Lightwave Logic Inc | Barclays Bank | (23.543) |
| | | Merrill Lynch | (9.307) | (67.916) | Lightwave Logic Inc | HSBC | (163.678) |
| 8.318 | Liberty Latin America Ltd 'C' | Barclays Bank | (6.031) | 1.419 | Limbach Holdings Inc | Bank of America | |
| 8.367 | Liberty Latin America Ltd 'C' | Goldman Sachs | (4.006) | | | Merrill Lynch | (957) |
| 36.078 | Liberty Latin America Ltd 'C' | Morgan Stanley | (26.157) | 3.808 | Limbach Holdings Inc | Barclays Bank | (3.389) |
| (14) | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A' | Bank of America | | 5.283 | Limbach Holdings Inc | Goldman Sachs | (906) |
| | | Merrill Lynch | 24 | 2.588 | Limbach Holdings Inc | HSBC | (1.690) |
| (24.102) | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A' | Goldman Sachs | 41.937 | 2.512 | Limbach Holdings Inc | Morgan Stanley | (518) |
| (12.056) | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A' | HSBC | 18.687 | (13.503) | Limoneira Co | Barclays Bank | 12.153 |
| (13.383) | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C' | Barclays Bank | 11.911 | (24.868) | Limoneira Co | Goldman Sachs | 9.947 |
| (22.999) | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C' | Goldman Sachs | 39.328 | (3.408) | Limoneira Co | HSBC | 3.033 |
| (9.721) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Bank of America | | 17.702 | Lincoln Educational Services Corp | Bank of America | |
| 339 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Merrill Lynch | 40.051 | | | Merrill Lynch | (354) |
| (2.338) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Barclays Bank | 4.325 | 10.070 | Lincoln Educational Services Corp | Goldman Sachs | (201) |
| (9.006) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Goldman Sachs | 37.105 | 31.287 | Lincoln Educational Services Corp | HSBC | 12.515 |
| 379 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Goldman Sachs | (1.561) | 13.660 | Lincoln Educational Services Corp | Morgan Stanley | (2.322) |
| (5.705) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | HSBC | 17.457 | (885) | Lincoln Electric Holdings Inc | Bank of America | |
| 493 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | HSBC | (1.509) | (1.644) | Lincoln Electric Holdings Inc | Merrill Lynch | (2.812) |
| (1.575) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Morgan Stanley | 2.914 | (8.819) | Lincoln Electric Holdings Inc | Barclays Bank | (2.334) |
| 831 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A' | Morgan Stanley | (1.537) | (12.653) | Lincoln Electric Holdings Inc | Goldman Sachs | (26.193) |
| (21.615) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Barclays Bank | 43.014 | (1.929) | Lincoln Electric Holdings Inc | HSBC | (39.638) |
| (17.595) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Goldman Sachs | 81.817 | (1.929) | Lincoln Electric Holdings Inc | Morgan Stanley | (5.546) |
| (2.460) | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Bank of America | | 4.222 | Lincoln National Corp | Barclays Bank | (3.631) |
| 1.371 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Merrill Lynch | 812 | (7.272) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Bank of America | |
| 2.156 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Merrill Lynch | (452) | (10.517) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Merrill Lynch | 6.181 |
| 30.815 | Li-Cycle Holdings Corp | Bank of America | | (2.353) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Barclays Bank | 7.730 |
| | | Merrill Lynch | 9.553 | (2.647) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | HSBC | 5.035 |
| 28.619 | Li-Cycle Holdings Corp | Barclays Bank | (3.148) | (2.647) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.946 |
| 8.081 | Li-Cycle Holdings Corp | Goldman Sachs | 2.505 | (10.979) | Linde Plc | Barclays Bank | 130.101 |
| 14.118 | Li-Cycle Holdings Corp | HSBC | (3.812) | (1.222) | Linde Plc | Goldman Sachs | 17.426 |
| 18.275 | Li-Cycle Holdings Corp | Morgan Stanley | (1.622) | (5.814) | Linde Plc | HSBC | 64.710 |
| (7.692) | Life Time Group Holdings Inc | Barclays Bank | 7.384 | (6.876) | Linde Plc | Morgan Stanley | 81.480 |
| 12.689 | Lifecore Biomedical Inc | Goldman Sachs | 48.726 | 1.753 | Lindsay Corp | Bank of America | |
| (6.212) | LifeMD Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.805) |
| | | Merrill Lynch | (2.112) | 956 | Lindsay Corp | Barclays Bank | 679 |
| (13.528) | LifeMD Inc | Barclays Bank | 812 | 2.027 | Lindsay Corp | HSBC | (3.243) |
| 10.666 | LifeStance Health Group Inc | Goldman Sachs | (4.586) | 5.132 | Lindsay Corp | Morgan Stanley | 3.644 |
| 6.463 | LifeStance Health Group Inc | HSBC | (3.102) | (63.597) | Lineage Cell Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (1.475) | Lifetime Brands Inc | Morgan Stanley | 325 | | | Merrill Lynch | 6.360 |
| 30.358 | Lifevantage Corp | Barclays Bank | (304) | (35.893) | Lineage Cell Therapeutics Inc | HSBC | 7.179 |
| 10.953 | Lifevantage Corp | Morgan Stanley | (110) | 20.715 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Barclays Bank | (1.243) |
| 321 | Ligand Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | 4.347 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | HSBC | (2.130) |
| | | Merrill Lynch | (2.420) | 13.239 | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | Barclays Bank | (1.192) |
| 5.233 | Ligand Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (27.683) | 8.224 | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | Goldman Sachs | (82) |
| 829 | Ligand Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (6.251) | 6.093 | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | HSBC | (2.681) |
| 1.005 | Ligand Pharmaceuticals Inc | HSBC | (7.437) | 9.784 | Lions Gate Entertainment Corp 'B' | Morgan Stanley | (881) |
| 440 | Ligand Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (2.328) | (25.156) | Liquidia Corp | Barclays Bank | 9.559 |
| (6.798) | Light & Wonder Inc | Bank of America | | (11.704) | Liquidia Corp | Goldman Sachs | (8.310) |
| | | Merrill Lynch | 36.812 | (3.848) | Liquidia Corp | Morgan Stanley | 1.462 |
| (59.707) | Light & Wonder Inc | Barclays Bank | 308.468 | (9.837) | Liquidity Services Inc | Bank of America | |
| (15.973) | Light & Wonder Inc | HSBC | 37.367 | | | Merrill Lynch | 2.656 |
| | | | | (3.666) | Liquidity Services Inc | Barclays Bank | 1.283 |
| | | | | (4.601) | Liquidity Services Inc | HSBC | (4.141) |
| | | | | (8.072) | Liquidity Services Inc | Morgan Stanley | 2.825 |
| | | | | 90 | Lithia Motors Inc | HSBC | 2.489 |
| | | | | (982) | Lithia Motors Inc | HSBC | (16.504) |
| | | | | (1.673) | Littelfuse Inc | Barclays Bank | 15.693 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (194) | Littelfuse Inc | Goldman Sachs | 93 | 18.377 | LSI Industries Inc | Barclays Bank | (16.539) |
| (178) | Littelfuse Inc | HSBC | (1.018) | 5.432 | LSI Industries Inc | Goldman Sachs | (2.553) |
| (115) | Littelfuse Inc | Morgan Stanley | 1.079 | 4.313 | LSI Industries Inc | HSBC | (2.631) |
| 1.372 | LivaNova Plc | Bank of America | | (63.772) | LTC Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 26.147 |
| | | Merrill Lynch | (4.747) | (42) | LTC Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 17 |
| 10.118 | LivaNova Plc | Barclays Bank | (18.921) | (186.034) | Lucid Group Inc | Barclays Bank | (5.581) |
| 837 | LivaNova Plc | Goldman Sachs | (1.512) | (31.645) | Lucid Group Inc | HSBC | 950 |
| 9.211 | LivaNova Plc | HSBC | (29.936) | (11.453) | Lucid Group Inc | Morgan Stanley | (344) |
| 1.030 | LivaNova Plc | Morgan Stanley | (1.926) | 4.888 | Lululemon Athletica Inc | Bank of America | |
| (577) | Live Nation Entertainment Inc | | | | Lululemon Athletica Inc | Merrill Lynch | (216.489) |
| | | Barclays Bank | 2.620 | 2.557 | Lululemon Athletica Inc | Barclays Bank | (81.057) |
| (410) | Live Nation Entertainment Inc | Goldman Sachs | 1.758 | 416 | Lululemon Athletica Inc | Morgan Stanley | (13.187) |
| 4.707 | Live Nation Entertainment Inc | | | (4.042) | Lulu's Fashion Lounge Holdings Inc | | |
| | | HSBC | 11.250 | (8.764) | Lulu's Fashion Lounge Holdings Inc | Barclays Bank | 970 |
| (980) | Live Nation Entertainment Inc | | | (3.567) | Lulu's Fashion Lounge Holdings Inc | HSBC | 964 |
| | | Morgan Stanley | 4.449 | (53.312) | Lumen Technologies Inc | Morgan Stanley | 856 |
| (4.649) | Live Oak Bancshares Inc | Bank of America | | 37.389 | Lumen Technologies Inc | Barclays Bank | (9.596) |
| | | Merrill Lynch | (2.046) | 54.180 | Lumen Technologies Inc | HSBC | (11.217) |
| (26.746) | Live Oak Bancshares Inc | Barclays Bank | 21.129 | (4.519) | Lumentum Holdings Inc | Morgan Stanley | (9.752) |
| (24.105) | Live Oak Bancshares Inc | HSBC | (31.196) | (5.156) | Lumentum Holdings Inc | Barclays Bank | (29.286) |
| (5.344) | Live Oak Bancshares Inc | Morgan Stanley | 4.222 | (1.805) | Lumentum Holdings Inc | Goldman Sachs | (12.356) |
| (11.850) | Livent Corp | Bank of America | | (2.753) | Lumentum Holdings Inc | HSBC | (16.683) |
| | | Merrill Lynch | 25.833 | (5.768) | Lumentum Holdings Inc | Morgan Stanley | (32.762) |
| (8.100) | Livent Corp | Barclays Bank | 8.910 | (10.262) | Luminar Technologies Inc | Barclays Bank | 616 |
| 1.308 | Livent Corp | Barclays Bank | (1.439) | (1.100) | Luminar Technologies Inc | Morgan Stanley | 66 |
| 5.757 | Livent Corp | Goldman Sachs | (7.507) | (1.800) | Lumos Pharma Inc | Bank of America | |
| (4.939) | Livent Corp | HSBC | 3.655 | (9.318) | Lumos Pharma Inc | Barclays Bank | (2.330) |
| 4.590 | Livent Corp | HSBC | (5.999) | (10) | Lumos Pharma Inc | Goldman Sachs | (8) |
| (11.610) | Livent Corp | Morgan Stanley | 12.771 | (27.778) | Luna Innovations Inc | Barclays Bank | (21.667) |
| 4.739 | Livent Corp | Morgan Stanley | (2.390) | (399) | Luna Innovations Inc | Goldman Sachs | (539) |
| 68.974 | LivePerson Inc | Barclays Bank | (58.628) | 38.448 | Luther Burbank Corp | Bank of America | |
| 3.986 | LivePerson Inc | Goldman Sachs | (2.551) | 10.292 | Luther Burbank Corp | Merrill Lynch | 11.534 |
| 1.037 | LivePerson Inc | HSBC | (591) | 21.960 | Luther Burbank Corp | Barclays Bank | (3.602) |
| 11.301 | LiveRamp Holdings Inc | Barclays Bank | (33.677) | 7.686 | Luther Burbank Corp | Goldman Sachs | 6.588 |
| 9.854 | LiveRamp Holdings Inc | Goldman Sachs | (6.307) | 4.924 | Luther Burbank Corp | HSBC | 3.151 |
| 2.764 | LiveRamp Holdings Inc | HSBC | 1.050 | 4.056 | Luxfer Holdings Plc | Morgan Stanley | (1.723) |
| 10.880 | LKQ Corp | Bank of America | | | Luxfer Holdings Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (57.120) | 8.529 | Luxfer Holdings Plc | Merrill Lynch | 243 |
| (3.944) | LKQ Corp | Morgan Stanley | 13.804 | 9.274 | Luxfer Holdings Plc | Barclays Bank | (5.288) |
| 6.985 | LL Flooring Holdings Inc | Bank of America | | 6.313 | Luxfer Holdings Plc | Goldman Sachs | 556 |
| | | Merrill Lynch | 10.610 | 7.707 | Luxfer Holdings Plc | HSBC | (3.472) |
| 24.140 | LL Flooring Holdings Inc | Barclays Bank | 28.702 | 50.589 | LXP Industrial Trust (REIT) | Morgan Stanley | (4.778) |
| 9.223 | LL Flooring Holdings Inc | Morgan Stanley | 10.966 | 30.554 | LXP Industrial Trust (REIT) | Bank of America | |
| (363) | Loews Corp | Bank of America | | 42.143 | LXP Industrial Trust (REIT) | Merrill Lynch | 12.458 |
| | | Merrill Lynch | 741 | 29.151 | LXP Industrial Trust (REIT) | Barclays Bank | (917) |
| (107.524) | Loews Corp | Barclays Bank | 220.424 | 30.875 | LXP Industrial Trust (REIT) | HSBC | 15.742 |
| (88.659) | Loews Corp | Goldman Sachs | 155.153 | (21.566) | Lyell Immunopharma Inc | Morgan Stanley | (926) |
| (45.163) | Loews Corp | HSBC | 98.456 | (12.422) | Lyell Immunopharma Inc | HSBC | (13.587) |
| (26.066) | Loews Corp | Morgan Stanley | 51.222 | 24.410 | Lyft Inc 'A' | Morgan Stanley | (497) |
| (1.622) | Lordstown Motors Corp 'A' | Bank of America | | | Lyft Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (7.031) | 11.596 | Lyft Inc 'A' | Merrill Lynch | 11.229 |
| (12.533) | Lordstown Motors Corp 'A' | Barclays Bank | 14.539 | 50.492 | Lyft Inc 'A' | HSBC | 5.334 |
| (328) | Lordstown Motors Corp 'A' | Goldman Sachs | 609 | 6.751 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Morgan Stanley | 45.443 |
| (210) | Lordstown Motors Corp 'A' | Morgan Stanley | 245 | 25.621 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Bank of America | |
| 2.921 | Louisiana-Pacific Corp | Bank of America | | (9.473) | LyondellBasell Industries NV 'A' | Merrill Lynch | (31.527) |
| | | Merrill Lynch | (7.031) | (3.380) | LyondellBasell Industries NV 'A' | Barclays Bank | (134.510) |
| (806) | Louisiana-Pacific Corp | Barclays Bank | 1.934 | 837 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Barclays Bank | 49.733 |
| 329 | Louisiana-Pacific Corp | Goldman Sachs | (117) | | | Goldman Sachs | 15.785 |
| 805 | Louisiana-Pacific Corp | HSBC | 389 | | | HSBC | (5.290) |
| 2.160 | Louisiana-Pacific Corp | Morgan Stanley | (1.843) | | | | |
| (2.367) | Lovesac Co | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 10.652 | | | | |
| (2.805) | Lovesac Co | HSBC | 14.642 | | | | |
| 1.118 | Lowe's Cos Inc | HSBC | (2.057) | | | | |
| 312 | LPL Financial Holdings Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 1.438 | | | | |
| 681 | LPL Financial Holdings Inc | HSBC | 2.044 | | | | |
| 981 | LPL Financial Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.285) | | | | |
| 7.181 | LSB Industries Inc | Barclays Bank | 2.011 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 7.134 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Morgan Stanley | (37.454) | (5.052) | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | HSBC | 3.233 |
| (843) | LyondellBasell Industries NV 'A' | Morgan Stanley | 4.426 | 6.488 | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | HSBC | (4.152) |
| (3.633) | M&T Bank Corp | Bank of America | | 36.863 | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Morgan Stanley | (53.083) |
| (7.639) | M&T Bank Corp | Merrill Lynch | (27.420) | (23.477) | Maiden Holdings Ltd | Barclays Bank | 3.052 |
| (3.002) | M&T Bank Corp | Barclays Bank | 4.874 | (11.151) | Maiden Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.338) |
| (6.447) | M&T Bank Corp | Goldman Sachs | (20.413) | (27.121) | Maiden Holdings Ltd | HSBC | 4.611 |
| (18.504) | M&T Bank Corp | HSBC | (15.089) | 6.405 | Malibu Boats Inc 'A' | Barclays Bank | (10.056) |
| (9.753) | M/I Homes Inc | Morgan Stanley | 13.549 | 114 | Malibu Boats Inc 'A' | HSBC | (660) |
| (8.971) | M/I Homes Inc | Barclays Bank | (5.657) | (2.387) | Malvern Bancorp Inc | Barclays Bank | 895 |
| (14.025) | M/I Homes Inc | Goldman Sachs | (15.071) | (1.994) | Malvern Bancorp Inc | Goldman Sachs | 70 |
| 36.333 | Macatawa Bank Corp | HSBC | (47.124) | (13.310) | Mammoth Energy Services Inc | HSBC | (6.487) |
| 34.668 | Macatawa Bank Corp | Barclays Bank | 4.178 | (11.513) | Mammoth Energy Services Inc | Goldman Sachs | 1.863 |
| 37.103 | Macerich Co (REIT) | Goldman Sachs | 8.494 | | Mammoth Energy Services Inc | Morgan Stanley | 5.526 |
| 7.332 | Macerich Co (REIT) | Goldman Sachs | (2.968) | 2.531 | Manhattan Associates Inc | Bank of America | |
| 635 | Macerich Co (REIT) | HSBC | (3.006) | | Manhattan Associates Inc | Merrill Lynch | 19.876 |
| (19.972) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley | (375) | 8.600 | Manhattan Associates Inc | Barclays Bank | 28.896 |
| (24.911) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Bank of America | (52.768) | 6.941 | Manhattan Associates Inc | Goldman Sachs | 55.142 |
| (9.861) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Merrill Lynch | (5.708) | 9.949 | Manhattan Associates Inc | HSBC | 107.077 |
| (16.879) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Barclays Bank | (26.526) | 23.472 | Manhattan Associates Inc | Morgan Stanley | 85.241 |
| (30.629) | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Goldman Sachs | (73.501) | 23.436 | Manitowoc Co Inc | Barclays Bank | (24.139) |
| 22.309 | MacroGenics Inc | HSBC | (4.594) | (10.525) | MannKind Corp | Bank of America | (105) |
| (32.448) | Macy's Inc | Morgan Stanley | (23.648) | (32.214) | MannKind Corp | Merrill Lynch | 8.054 |
| (2.549) | Macy's Inc | Barclays Bank | 23.858 | (72.687) | MannKind Corp | Barclays Bank | (727) |
| 7.945 | Macy's Inc | Barclays Bank | 3.033 | (15.287) | MannKind Corp | HSBC | (10.089) |
| 13.313 | Macy's Inc | Bank of America | (9.455) | 683 | ManpowerGroup Inc | Bank of America | |
| (19.341) | Macy's Inc | Merrill Lynch | (20.502) | 7.419 | ManpowerGroup Inc | Merrill Lynch | (1.223) |
| 12.058 | Macy's Inc | Barclays Bank | (15.917) | 408 | ManpowerGroup Inc | Barclays Bank | (33.089) |
| (7.125) | Macy's Inc | Goldman Sachs | 4.859 | 12.234 | ManpowerGroup Inc | Goldman Sachs | (730) |
| (1.192) | Madison Square Garden Entertainment Corp | HSBC | (1.894) | 585 | ManpowerGroup Inc | HSBC | (12.723) |
| (6.026) | Madison Square Garden Entertainment Corp | Morgan Stanley | 9.289 | 48.334 | ManpowerGroup Inc | Morgan Stanley | (2.609) |
| (2.380) | Madison Square Garden Entertainment Corp | Bank of America | (13.780) | 119.993 | Marathon Oil Corp | Barclays Bank | (52.684) |
| (1.704) | Madison Square Garden Entertainment Corp | Merrill Lynch | (2.300) | 29.222 | Marathon Oil Corp | Goldman Sachs | (40.018) |
| (4.017) | Madison Square Garden Entertainment Corp | Barclays Bank | 15.969 | 39.419 | Marathon Oil Corp | HSBC | (14.027) |
| 4.049 | Madison Square Garden Sports Corp | Goldman Sachs | (9.100) | 356 | Marathon Oil Corp | Morgan Stanley | (42.966) |
| 1.482 | Madison Square Garden Sports Corp | HSBC | (8.097) | 2.698 | Marathon Petroleum Corp | Bank of America | |
| 591 | Madison Square Garden Sports Corp | Morgan Stanley | (11.457) | 716 | Marathon Petroleum Corp | Merrill Lynch | (1.894) |
| 1.866 | Madison Square Garden Sports Corp | Barclays Bank | 9.044 | 2.229 | Marathon Petroleum Corp | Barclays Bank | (14.353) |
| (1.163) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 7.411 | 5.901 | Marathon Petroleum Corp | Goldman Sachs | (3.809) |
| (1.681) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | HSBC | 31.147 | (2.609) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | HSBC | (8.484) |
| (728) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (8.097) | (6.151) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (31.393) |
| (1.083) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Bank of America | (11.457) | (19.068) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Bank of America | 7.840 |
| (817) | Madrigal Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 11.840 | (17.046) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | 9.872 |
| (4.259) | Magnite Inc | Barclays Bank | 3.620 | (2.880) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 57.299 |
| (31.293) | Magnite Inc | Goldman Sachs | (88.872) | 48.952 | Marchex Inc 'B' | HSBC | 32.473 |
| 20.066 | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Morgan Stanley | 4.396 | 35.474 | Marchex Inc 'B' | Morgan Stanley | 4.622 |
| 83.431 | Magnolia Oil & Gas Corp 'A' | Barclays Bank | (120.141) | 22.343 | Marcus & Millichap Inc | Goldman Sachs | 9.301 |
| | | | | 54.312 | Marcus Corp | Barclays Bank | (28.376) |
| | | | | (15.891) | Marine Products Corp | HSBC | (142.841) |
| | | | | (2.010) | Marine Products Corp | Barclays Bank | (6.992) |
| | | | | (1.389) | Marine Products Corp | Goldman Sachs | (2.010) |
| | | | | (3.759) | MarineMax Inc | HSBC | (1.250) |
| | | | | (5.328) | MarineMax Inc | Bank of America | |
| | | | | (2.178) | MarineMax Inc | Merrill Lynch | (1.316) |
| | | | | (26.623) | MarineMax Inc | Barclays Bank | (799) |
| | | | | 7.207 | Marinus Pharmaceuticals Inc | HSBC | 128 |
| | | | | 5.356 | Marinus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.772) |
| | | | | | Marinus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (10.018) |
| | | | | | Marinus Pharmaceuticals Inc | HSBC | (10.337) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (213) | Markel Group Inc | Bank of America | | (571) | MasTec Inc | Goldman Sachs | (3.453) |
| | | Merrill Lynch | 8.912 | (2.000) | MasTec Inc | HSBC | (12.096) |
| (2.752) | Markel Group Inc | Barclays Bank | 82.835 | (2.880) | MasTec Inc | Morgan Stanley | (6.857) |
| (959) | Markel Group Inc | Goldman Sachs | 40.125 | 2.084 | Mastech Digital Inc | Bank of America | |
| (345) | Markel Group Inc | HSBC | 13.049 | | | Merrill Lynch | 2.230 |
| (853) | Markel Group Inc | Morgan Stanley | 24.017 | 3.135 | Mastech Digital Inc | Barclays Bank | 2.633 |
| (381) | MarketAxess Holdings Inc | Bank of America | | 3.484 | Mastech Digital Inc | HSBC | 3.589 |
| | | Merrill Lynch | 6.690 | 2.074 | Mastech Digital Inc | Morgan Stanley | 1.742 |
| (611) | MarketAxess Holdings Inc | Goldman Sachs | 10.729 | (28.043) | Masterbrand Inc | Bank of America | |
| (405) | MarketAxess Holdings Inc | HSBC | 9.509 | | | Merrill Lynch | 10.937 |
| (884) | MarketAxess Holdings Inc | Morgan Stanley | 9.362 | (90.887) | Masterbrand Inc | Barclays Bank | 51.805 |
| (43.078) | Markforged Holding Corp | Barclays Bank | 2.141 | (28.038) | Masterbrand Inc | Goldman Sachs | 10.935 |
| (42.200) | Markforged Holding Corp | HSBC | (4.887) | (20.201) | Masterbrand Inc | HSBC | (39.594) |
| 13.676 | Marqeta Inc 'A' | Bank of America | | (12.160) | Masterbrand Inc | Morgan Stanley | 6.931 |
| | | Merrill Lynch | 618 | 3.138 | Mastercard Inc 'A' | Barclays Bank | (77.069) |
| 91.273 | Marqeta Inc 'A' | Barclays Bank | (6.389) | 3.114 | Mastercard Inc 'A' | Goldman Sachs | (72.992) |
| 36.402 | Marqeta Inc 'A' | Goldman Sachs | (364) | 1.356 | Mastercard Inc 'A' | Morgan Stanley | (33.303) |
| 36.881 | Marqeta Inc 'A' | HSBC | 7.745 | 13.600 | MasterCraft Boat Holdings Inc | Bank of America | |
| 15.180 | Marqeta Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.062) | | | Merrill Lynch | (22.036) |
| (9.593) | Marriott International Inc 'A' | Bank of America | | 9.301 | MasterCraft Boat Holdings Inc | Barclays Bank | (17.672) |
| | | Merrill Lynch | 80.958 | 19.918 | MasterCraft Boat Holdings Inc | Goldman Sachs | (33.908) |
| (14.687) | Marriott International Inc 'A' | Barclays Bank | 113.971 | 8.936 | MasterCraft Boat Holdings Inc | HSBC | (22.792) |
| (11.150) | Marriott International Inc 'A' | Goldman Sachs | 95.224 | 6.362 | MasterCraft Boat Holdings Inc | Morgan Stanley | (9.176) |
| (5.383) | Marriott International Inc 'A' | HSBC | 55.577 | 3.919 | Matador Resources Co | Bank of America | |
| (3.114) | Marriott International Inc 'A' | Morgan Stanley | 24.165 | | | Merrill Lynch | (1.528) |
| 1.871 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Bank of America | | (2.171) | Matador Resources Co | Barclays Bank | 6.556 |
| | | Merrill Lynch | (2.301) | 24.553 | Matador Resources Co | Barclays Bank | (74.150) |
| 3.071 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Barclays Bank | (7.708) | 1.239 | Matador Resources Co | Goldman Sachs | (483) |
| 8.949 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Goldman Sachs | (11.007) | 8.222 | Matador Resources Co | HSBC | (4.285) |
| 17.670 | Marriott Vacations Worldwide Corp | HSBC | (104.783) | 7.035 | Matador Resources Co | Morgan Stanley | (21.246) |
| 374 | Marsh & McLennan Cos Inc | Bank of America | | (8.616) | Matador Resources Co | Morgan Stanley | 26.020 |
| | | Merrill Lynch | (3.445) | 4.457 | Match Group Inc | Bank of America | |
| 17.944 | Marsh & McLennan Cos Inc | Barclays Bank | (131.709) | | | Merrill Lynch | 8.736 |
| 21.586 | Marsh & McLennan Cos Inc | Goldman Sachs | (198.807) | 18.114 | Match Group Inc | Barclays Bank | 7.608 |
| 832 | Marsh & McLennan Cos Inc | HSBC | (6.397) | 18.758 | Match Group Inc | Goldman Sachs | 36.766 |
| 43.870 | Marten Transport Ltd | Barclays Bank | (10.529) | 14.303 | Match Group Inc | HSBC | 27.462 |
| 4.966 | Marten Transport Ltd | Morgan Stanley | (1.192) | 21.640 | Match Group Inc | Morgan Stanley | 9.089 |
| (1.656) | Martin Marietta Materials Inc | Morgan Stanley | 18.878 | (2.478) | Materion Corp | Morgan Stanley | 7.161 |
| (31.908) | Marvell Technology Inc | Bank of America | | (1.061) | Mativ Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (560.642) | | | Merrill Lynch | 2.592 |
| (4.012) | Marvell Technology Inc | Barclays Bank | (62.226) | (15.809) | Mativ Holdings Inc | Barclays Bank | 38.732 |
| (24.306) | Marvell Technology Inc | HSBC | (476.050) | (1.371) | Mativ Holdings Inc | Morgan Stanley | 3.359 |
| (44.536) | Marvell Technology Inc | Morgan Stanley | (678.983) | 6.420 | Matrix Service Co | Barclays Bank | (2.953) |
| (6.178) | Masco Corp | Bank of America | | 38.225 | Matrix Service Co | Goldman Sachs | (35.549) |
| | | Merrill Lynch | 18.040 | 10.512 | Matson Inc | Barclays Bank | (2.313) |
| (59.121) | Masco Corp | Barclays Bank | 153.715 | 6.799 | Matson Inc | HSBC | 26.856 |
| (33.883) | Masco Corp | Goldman Sachs | 98.939 | (32.930) | Mattel Inc | Barclays Bank | 20.087 |
| (3.040) | Masco Corp | HSBC | 13.217 | (39.497) | Mattel Inc | Goldman Sachs | 55.691 |
| (6.977) | Masco Corp | Morgan Stanley | 18.140 | (33.946) | Mattel Inc | HSBC | 15.384 |
| (717) | Masimo Corp | Bank of America | | (24.610) | Mattel Inc | Morgan Stanley | 15.012 |
| | | Merrill Lynch | 9.995 | 39.278 | Matterport Inc | Bank of America | |
| (446) | Masimo Corp | Barclays Bank | 1.565 | | | Merrill Lynch | 1.571 |
| 673 | Masimo Corp | Barclays Bank | (2.362) | 8.408 | Matterport Inc | Morgan Stanley | 1.177 |
| (1.245) | Masimo Corp | Goldman Sachs | 17.355 | (747) | Matthews International Corp 'A' | Bank of America | |
| (217) | Masimo Corp | HSBC | 6.148 | | | Merrill Lynch | 465 |
| 935 | Masimo Corp | HSBC | (26.489) | (12.445) | Matthews International Corp 'A' | Goldman Sachs | (18.170) |
| (3.186) | Masimo Corp | Morgan Stanley | 11.183 | (25.156) | Matthews International Corp 'A' | HSBC | (50.451) |
| (3.353) | Masonite International Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 4.929 | (3.281) | Matthews International Corp 'A' | Morgan Stanley | (475) |
| (9.683) | Masonite International Corp | Barclays Bank | 39.313 | 13.932 | Maui Land & Pineapple Co Inc | Barclays Bank | (19.226) |
| (2.596) | Masonite International Corp | Goldman Sachs | 3.816 | 103 | MaxCyte Inc | Barclays Bank | (8) |
| (9.408) | Masonite International Corp | HSBC | 29.165 | 15.089 | MaxCyte Inc | Morgan Stanley | (1.207) |
| (3.421) | Masonite International Corp | Morgan Stanley | 13.889 | (24.708) | Maximus Inc | Barclays Bank | 36.321 |
| (3.022) | MasTec Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (10.885) | | | | |
| (3.360) | MasTec Inc | Barclays Bank | (7.237) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|-------------------------------------|-----------------|---|--|---------------------------|-----------------|---|
| Verenigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Verenigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (14.857) | Maximus Inc | Goldman Sachs | (10.399) | 16.897 | MeiraGTx Holdings Plc | Goldman Sachs | 14.616 |
| (11.103) | Maximus Inc | HSBC | (9.005) | 8.289 | MeiraGTx Holdings Plc | HSBC | 9.408 |
| (7.521) | Maximus Inc | Morgan Stanley | 11.055 | 28.427 | MeiraGTx Holdings Plc | Morgan Stanley | (3.838) |
| 24.233 | MaxLinear Inc | Bank of America | | 43 | MercadoLibre Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 109.775 | | | Merrill Lynch | (1.862) |
| 38.624 | MaxLinear Inc | Barclays Bank | 17.768 | 199 | MercadoLibre Inc | Barclays Bank | (17.113) |
| 3.456 | MaxLinear Inc | Goldman Sachs | 15.656 | 180 | MercadoLibre Inc | Goldman Sachs | (10.392) |
| 39.902 | MaxLinear Inc | HSBC | 226.643 | 68 | MercadoLibre Inc | HSBC | (3.474) |
| 34.915 | MaxLinear Inc | Morgan Stanley | 16.061 | 103 | MercadoLibre Inc | Morgan Stanley | (10.175) |
| 23.897 | Mayville Engineering Co Inc | Barclays Bank | (23.180) | 21.890 | Mercantile Bank Corp | Bank of America | |
| 413 | Mayville Engineering Co Inc | Goldman Sachs | 128 | | | Merrill Lynch | 33.492 |
| 7.587 | MBA Inc | Bank of America | | 4.312 | Mercantile Bank Corp | Barclays Bank | (2.070) |
| | | Merrill Lynch | 835 | 8.473 | Mercantile Bank Corp | Goldman Sachs | 12.964 |
| 17.622 | MBA Inc | Barclays Bank | 4.053 | 7.268 | Mercantile Bank Corp | HSBC | 11.701 |
| (3.957) | McCormick & Co Inc | Bank of America | | 3.457 | Mercantile Bank Corp | Morgan Stanley | (1.659) |
| | | Merrill Lynch | 23.861 | (4.172) | Merchants Bancorp | Bank of America | |
| (3.418) | McCormick & Co Inc | Goldman Sachs | 20.611 | | | Merrill Lynch | (1.210) |
| (15.593) | McCormick & Co Inc | HSBC | 54.108 | (5.439) | Merchants Bancorp | Barclays Bank | 2.230 |
| (2.121) | McDonald's Corp | Bank of America | | (9.514) | Merchants Bancorp | HSBC | (1.047) |
| | | Merrill Lynch | 24.985 | (5.197) | Merchants Bancorp | Morgan Stanley | 2.131 |
| (2.889) | McDonald's Corp | Barclays Bank | 15.109 | (4.291) | Merck & Co Inc | Bank of America | |
| (865) | McDonald's Corp | Goldman Sachs | 10.190 | | | Merrill Lynch | 30.853 |
| (2.703) | McDonald's Corp | HSBC | 33.977 | (9.388) | Merck & Co Inc | Barclays Bank | 49.850 |
| 2.017 | McGrath RentCorp | Bank of America | | (10.644) | Merck & Co Inc | Goldman Sachs | 76.531 |
| | | Merrill Lynch | (2.945) | (1.559) | Merck & Co Inc | HSBC | 11.201 |
| 5.063 | McGrath RentCorp | Barclays Bank | (8.050) | (2.409) | Merck & Co Inc | Morgan Stanley | 12.792 |
| 7.026 | McGrath RentCorp | Goldman Sachs | (10.258) | 3.040 | Mercury General Corp | Bank of America | |
| 17.041 | McGrath RentCorp | HSBC | (15.166) | | | Merrill Lynch | 669 |
| 1.086 | McGrath RentCorp | Morgan Stanley | (1.727) | 3.124 | Mercury General Corp | Barclays Bank | (2.655) |
| 1.659 | McKesson Corp | Bank of America | | 2.824 | Mercury General Corp | Goldman Sachs | 621 |
| | | Merrill Lynch | (10.883) | 35.866 | Mercury General Corp | HSBC | 25.465 |
| 296 | McKesson Corp | Barclays Bank | (3.505) | (7.446) | Mercury Systems Inc | Bank of America | |
| 551 | McKesson Corp | Goldman Sachs | (3.615) | | | Merrill Lynch | 12.658 |
| 2.295 | McKesson Corp | HSBC | 36.789 | (3.900) | Mercury Systems Inc | Barclays Bank | 5.421 |
| 858 | McKesson Corp | Morgan Stanley | (10.159) | (11.005) | Mercury Systems Inc | Goldman Sachs | 18.709 |
| 11.508 | MDC Holdings Inc | Barclays Bank | (7.020) | (16.247) | Mercury Systems Inc | HSBC | (12.023) |
| (5.471) | MDU Resources Group Inc | Barclays Bank | 5.416 | (12.618) | Mercury Systems Inc | Morgan Stanley | 17.539 |
| (4.293) | MDU Resources Group Inc | Goldman Sachs | 1.889 | 10.539 | Meridian Corp | Bank of America | |
| (33.189) | MDU Resources Group Inc | HSBC | 1.659 | | | Merrill Lynch | 4.953 |
| (47.094) | MDU Resources Group Inc | Morgan Stanley | 46.623 | 36.538 | Meridian Corp | Barclays Bank | 1.096 |
| (15.260) | Medallion Financial Corp | Barclays Bank | 2.594 | 28.814 | Meridian Corp | HSBC | 22.475 |
| (18.888) | Medallion Financial Corp | Goldman Sachs | 2.078 | 14.890 | Meridian Corp | Morgan Stanley | 447 |
| 5.985 | MediaAlpha Inc 'A' | Bank of America | | (1.152) | MeridianLink Inc | Barclays Bank | (46) |
| | | Merrill Lynch | 17.656 | (23.918) | MeridianLink Inc | Goldman Sachs | (54.055) |
| 3.263 | MediaAlpha Inc 'A' | Goldman Sachs | 9.626 | (8.106) | MeridianLink Inc | HSBC | (26.426) |
| 1.434 | MediaAlpha Inc 'A' | HSBC | 3.757 | (16.220) | MeridianLink Inc | Morgan Stanley | (649) |
| 1.238 | MediaAlpha Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.387 | 10.953 | Merit Medical Systems Inc | Bank of America | |
| (31.129) | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (30.887) |
| | | Merrill Lynch | (19.923) | 26.498 | Merit Medical Systems Inc | Barclays Bank | (82.674) |
| (76.578) | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (16.081) | 10.175 | Merit Medical Systems Inc | Goldman Sachs | (28.694) |
| | | | | 9.895 | Merit Medical Systems Inc | HSBC | (34.830) |
| 9.869 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 6.316 | 12.981 | Merit Medical Systems Inc | Morgan Stanley | (40.501) |
| 14.060 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | HSBC | (7.592) | (2.604) | Meritage Homes Corp | Bank of America | |
| (9.535) | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (2.002) | | | Merrill Lynch | 18.749 |
| (1.573) | Medifast Inc | Bank of America | | (32.233) | Meritage Homes Corp | Barclays Bank | 101.534 |
| | | Merrill Lynch | 10.536 | (23.167) | Meritage Homes Corp | Goldman Sachs | 166.802 |
| (943) | Medifast Inc | Barclays Bank | 2.993 | (9.099) | Meritage Homes Corp | HSBC | 87.897 |
| (295) | Medifast Inc | HSBC | 196 | (1.898) | Meritage Homes Corp | Morgan Stanley | 5.979 |
| (3.649) | Medifast Inc | Morgan Stanley | 34.775 | 11.763 | Mersana Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (10.940) |
| (1.366) | Medpace Holdings Inc | Barclays Bank | 5.314 | (2.862) | Mesa Air Group Inc | Barclays Bank | 458 |
| (448) | Medpace Holdings Inc | HSBC | 1.725 | (3.502) | Mesa Air Group Inc | HSBC | 1.331 |
| 581 | Medpace Holdings Inc | HSBC | (2.237) | (23.696) | Mesa Air Group Inc | Morgan Stanley | 3.791 |
| (4.697) | Medpace Holdings Inc | Morgan Stanley | 18.271 | (89) | Mesa Laboratories Inc | Bank of America | |
| (7.193) | Medtronic Plc | Barclays Bank | 52.653 | | | Merrill Lynch | 2.403 |
| 6.212 | Medtronic Plc | Goldman Sachs | (44.292) | (3.250) | Mesa Laboratories Inc | Barclays Bank | 84.630 |
| (1.762) | Medtronic Plc | Goldman Sachs | 12.563 | (3.283) | Mesa Laboratories Inc | HSBC | 99.508 |
| (576) | Medtronic Plc | HSBC | 4.614 | 212 | Meta Platforms Inc 'A' | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 4.952 |
| | | | | 2.204 | Meta Platforms Inc 'A' | Barclays Bank | 26.162 |
| | | | | 718 | Meta Platforms Inc 'A' | Goldman Sachs | 16.773 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 810 | Meta Platforms Inc 'A' | HSBC | 21.156 | 129 | MicroStrategy Inc 'A' | Barclays Bank | (293) |
| 514 | Meta Platforms Inc 'A' | Morgan Stanley | 6.996 | (248) | MicroStrategy Inc 'A' | Morgan Stanley | (717) |
| (9.447) | Methode Electronics Inc | Barclays Bank | (9.919) | (50.321) | Microvast Holdings Inc | Morgan Stanley | 46.044 |
| (22.368) | Methode Electronics Inc | Goldman Sachs | (55.249) | 3.645 | Mid Penn Bancorp Inc | Bank of America | |
| (15.861) | Methode Electronics Inc | HSBC | (39.970) | | | Merrill Lynch | 8.839 |
| 5.024 | MetLife Inc | Bank of America | | 12.933 | Mid Penn Bancorp Inc | Barclays Bank | 6.790 |
| | | Merrill Lynch | (804) | 850 | Mid Penn Bancorp Inc | Goldman Sachs | 2.427 |
| 177.834 | MetLife Inc | Barclays Bank | (362.391) | 6.129 | Mid Penn Bancorp Inc | HSBC | 20.408 |
| 12.897 | MetLife Inc | Goldman Sachs | (2.063) | 6.403 | Mid Penn Bancorp Inc | Morgan Stanley | 3.362 |
| 40.175 | MetLife Inc | HSBC | (134.209) | 441 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Bank of America | |
| 63.397 | MetLife Inc | Morgan Stanley | (129.964) | | | Merrill Lynch | (2.104) |
| (6.432) | Metrocity Bankshares Inc | Bank of America | | 19.959 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Barclays Bank | 5.788 |
| | | Merrill Lynch | (7.075) | 643 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.067) |
| (28.233) | Metrocity Bankshares Inc | Barclays Bank | (13.552) | 1.990 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | HSBC | (8.836) |
| (26.645) | Metrocity Bankshares Inc | Goldman Sachs | (29.310) | 4.154 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.205 |
| (11.001) | Metrocity Bankshares Inc | HSBC | (21.672) | (4.459) | Middleby Corp | Barclays Bank | 38.035 |
| (4.956) | Metrocity Bankshares Inc | Morgan Stanley | (2.379) | (414) | Middleby Corp | HSBC | 5.212 |
| (17.726) | Metropolitan Bank Holding Corp | Morgan Stanley | (46.974) | (1.400) | Middleby Corp | Morgan Stanley | 11.942 |
| 56 | Mettler-Toledo International Inc | Barclays Bank | (5.420) | 4.444 | Middlefield Banc Corp | Bank of America | |
| 467 | Mettler-Toledo International Inc | Goldman Sachs | (39.270) | 7.376 | Middlefield Banc Corp | Merrill Lynch | 11.110 |
| 73 | Mettler-Toledo International Inc | HSBC | (6.717) | 6.981 | Middlefield Banc Corp | Barclays Bank | 17.407 |
| 235 | Mettler-Toledo International Inc | Morgan Stanley | (22.746) | 3.864 | Middlefield Banc Corp | Goldman Sachs | 17.452 |
| (11.003) | MFA Financial Inc (REIT) | Bank of America | | 1.923 | Middlefield Banc Corp | HSBC | 1.971 |
| | | Merrill Lynch | (4.731) | (1.338) | Middlefield Banc Corp | Morgan Stanley | 4.538 |
| (17.188) | MFA Financial Inc (REIT) | Barclays Bank | 4.985 | | Middlesex Water Co | Bank of America | |
| (15.446) | MFA Financial Inc (REIT) | HSBC | (1.699) | (835) | Middlesex Water Co | Merrill Lynch | (6.686) |
| (7.349) | MFA Financial Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.131 | (3.244) | Middlesex Water Co | Barclays Bank | (2.797) |
| (1.961) | MGE Energy Inc | Bank of America | | (6.006) | Middlesex Water Co | HSBC | (11.807) |
| | | Merrill Lynch | 9.588 | 26.311 | Midland States Bancorp Inc | Morgan Stanley | (5.673) |
| (3.462) | MGE Energy Inc | Barclays Bank | 11.667 | 33.191 | Midland States Bancorp Inc | Bank of America | |
| (29.731) | MGE Energy Inc | HSBC | 150.810 | 10.362 | Midland States Bancorp Inc | Merrill Lynch | 26.311 |
| (6.810) | MGE Energy Inc | Morgan Stanley | 21.184 | 27.711 | Midland States Bancorp Inc | Barclays Bank | (996) |
| (51.260) | MGIC Investment Corp | Bank of America | | 13.555 | Midland States Bancorp Inc | Goldman Sachs | 10.362 |
| | | Merrill Lynch | (23.580) | 997 | MidWestOne Financial Group Inc | HSBC | 23.554 |
| (12.647) | MGIC Investment Corp | Barclays Bank | (3.541) | 41.744 | MidWestOne Financial Group Inc | Morgan Stanley | (407) |
| (8.863) | MGIC Investment Corp | HSBC | (5.229) | 27.590 | MidWestOne Financial Group Inc | Bank of America | |
| (6.444) | MGIC Investment Corp | Morgan Stanley | (1.804) | 8.709 | MidWestOne Financial Group Inc | Merrill Lynch | 668 |
| 19.558 | MGM Resorts International | Bank of America | | 6.473 | MidWestOne Financial Group Inc | Barclays Bank | (9.601) |
| | | Merrill Lynch | (68.648) | | | Goldman Sachs | 18.485 |
| 26.097 | MGM Resorts International | Barclays Bank | (82.206) | | | HSBC | (1.916) |
| 60.546 | MGM Resorts International | Goldman Sachs | (208.114) | | | Morgan Stanley | (1.489) |
| 31.143 | MGM Resorts International | HSBC | (132.669) | (101.369) | Milestone Scientific Inc | Barclays Bank | — |
| 14.850 | MGM Resorts International | Morgan Stanley | (46.778) | (20.990) | Milestone Scientific Inc | Goldman Sachs | (2.729) |
| 2.400 | MGP Ingredients Inc | Bank of America | | 4.625 | Miller Industries Inc | Barclays Bank | (4.509) |
| | | Merrill Lynch | (14.064) | (27.640) | MillerKnoll Inc | Barclays Bank | 45.882 |
| 3.893 | MGP Ingredients Inc | Barclays Bank | (39.319) | (5.711) | MillerKnoll Inc | HSBC | 16.105 |
| 817 | MGP Ingredients Inc | Goldman Sachs | (4.788) | 45.604 | MiMedx Group Inc | Bank of America | |
| 6.024 | MGP Ingredients Inc | HSBC | (36.987) | | | Merrill Lynch | (12.313) |
| 8.061 | MGP Ingredients Inc | Morgan Stanley | (81.416) | 21.739 | MiMedx Group Inc | Goldman Sachs | (5.870) |
| 7.969 | Microchip Technology Inc | Bank of America | | 2.648 | Mind Medicine MindMed Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (7.590) | 9.147 | Mind Medicine MindMed Inc | Merrill Lynch | 1.192 |
| 11.749 | Microchip Technology Inc | Barclays Bank | (35.599) | 2.771 | Mind Medicine MindMed Inc | Barclays Bank | 274 |
| 3.629 | Microchip Technology Inc | Goldman Sachs | 2.831 | (15.882) | Minerals Technologies Inc | HSBC | 610 |
| 2.642 | Microchip Technology Inc | HSBC | 7.934 | (17.488) | Minerals Technologies Inc | Barclays Bank | 69.563 |
| 3.817 | Microchip Technology Inc | Morgan Stanley | 7.684 | (2.869) | Minerals Technologies Inc | Goldman Sachs | 63.656 |
| 2.910 | MicroCloud Hologram Inc | Barclays Bank | 698 | (4.399) | Minerals Technologies Inc | HSBC | 16.239 |
| 2.682 | Micron Technology Inc | Barclays Bank | (2.220) | (10.632) | Minerals Technologies Inc | Morgan Stanley | 19.268 |
| (1.306) | Micron Technology Inc | Goldman Sachs | (5.250) | (3.016) | Mineralys Therapeutics Inc | Barclays Bank | 21.370 |
| 1.191 | Micron Technology Inc | HSBC | (6.286) | 51.209 | Mineralys Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 6.062 |
| 1.369 | Microsoft Corp | Bank of America | | 1.884 | Miragen Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (51) |
| | | Merrill Lynch | 21.779 | (1.424) | Miragen Therapeutics Inc | Morgan Stanley | — |
| 6.968 | Microsoft Corp | Barclays Bank | 94.100 | | Mirati Therapeutics Inc | Barclays Bank | 13.678 |
| 172 | Microsoft Corp | Goldman Sachs | 4.358 | | | | |
| 2.814 | Microsoft Corp | HSBC | 61.964 | | | | |
| 5.855 | Microsoft Corp | Morgan Stanley | 71.123 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (974) | Mirati Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 9.355 | (10.016) | Momentive Global Inc | Barclays Bank | (651) |
| (599) | Mirion Technologies Inc | Barclays Bank | 96 | (18.646) | Momentive Global Inc | HSBC | (1.585) |
| (24.585) | Mirion Technologies Inc | Morgan Stanley | 3.934 | (15.405) | Momentive Global Inc | Morgan Stanley | (1.001) |
| 5.476 | Mirum Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (9.200) | (14.920) | Momentus Inc | Goldman Sachs | 366 |
| 2.991 | Mirum Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 658 | (98.054) | Momentus Inc | Morgan Stanley | 2.902 |
| 244 | Mirum Pharmaceuticals Inc | HSBC | (27) | 16.529 | Monarch Casino & Resort Inc | | |
| (4.931) | Mission Produce Inc | Bank of America | | | Monarch Casino & Resort Inc | Barclays Bank | (45.785) |
| | | Merrill Lynch | (1.627) | 8.298 | Monarch Casino & Resort Inc | HSBC | (18.588) |
| (2.245) | Mission Produce Inc | Barclays Bank | 112 | | | | |
| (3.389) | Mission Produce Inc | Goldman Sachs | (1.118) | 5.619 | Monarch Casino & Resort Inc | Morgan Stanley | (15.565) |
| (5.381) | Mission Produce Inc | HSBC | (477) | | | | |
| (4.417) | Mission Produce Inc | Morgan Stanley | 1.249 | (1.444) | Mondelez International Inc 'A' | Bank of America | |
| 24.310 | Mister Car Wash Inc | Barclays Bank | 729 | | Mondelez International Inc 'A' | Merrill Lynch | 6.144 |
| 57.252 | Mister Car Wash Inc | Goldman Sachs | (37.214) | (23.549) | Mondelez International Inc 'A' | | |
| 48.144 | Mister Car Wash Inc | HSBC | (30.330) | | Mondelez International Inc 'A' | Barclays Bank | 74.886 |
| 13.757 | Mister Car Wash Inc | Morgan Stanley | 413 | (2.377) | Mondelez International Inc 'A' | Goldman Sachs | 10.602 |
| 37.502 | Mistras Group Inc | Bank of America | | (31.443) | Mondelez International Inc 'A' | HSBC | 170.421 |
| | | Merrill Lynch | 18.001 | (52.762) | Mondelez International Inc 'A' | Morgan Stanley | 164.500 |
| 18.537 | Mistras Group Inc | Barclays Bank | 2.595 | | | Barclays Bank | 347 |
| 12.864 | Mistras Group Inc | Goldman Sachs | 6.175 | 386 | Moneylion Inc | Goldman Sachs | (1.532) |
| 241 | Mistras Group Inc | HSBC | 116 | 856 | Moneylion Inc | HSBC | (3.719) |
| 43.472 | Mistras Group Inc | Morgan Stanley | 6.086 | 436 | Moneylion Inc | Bank of America | |
| (32.060) | Mitek Systems Inc | Barclays Bank | (11.978) | (1.275) | MongoDB Inc | Merrill Lynch | (27.085) |
| (27.840) | Mitek Systems Inc | HSBC | (30.857) | | MongoDB Inc | Barclays Bank | (12.649) |
| (4.411) | MKS Instruments Inc | Bank of America | | (910) | MongoDB Inc | Goldman Sachs | (1.661) |
| | | Merrill Lynch | (56.284) | (79) | MongoDB Inc | HSBC | (40.459) |
| (16.522) | MKS Instruments Inc | Barclays Bank | (130.028) | (805) | MongoDB Inc | Morgan Stanley | (14.414) |
| (4.101) | MKS Instruments Inc | Goldman Sachs | (52.329) | (1.037) | MongoDB Inc | Bank of America | |
| (13.447) | MKS Instruments Inc | HSBC | (207.218) | 470 | Monolithic Power Systems Inc | Merrill Lynch | 46.737 |
| (13.061) | MKS Instruments Inc | Morgan Stanley | (102.790) | | | | |
| 6.934 | Model N Inc | Barclays Bank | 12.828 | 341 | Monolithic Power Systems Inc | Barclays Bank | 21.688 |
| 15.191 | Model N Inc | Goldman Sachs | 39.649 | 1.202 | Monolithic Power Systems Inc | Morgan Stanley | 76.447 |
| (2.931) | Moderna Inc | Barclays Bank | (4.543) | | | Barclays Bank | 22.357 |
| (410) | Moderna Inc | Goldman Sachs | (113) | (19.648) | Monro Inc | Goldman Sachs | 7.401 |
| (660) | Moderna Inc | HSBC | 2.284 | (1.123) | Monro Inc | HSBC | 52.892 |
| (1.271) | Moderna Inc | Morgan Stanley | (1.970) | (13.619) | Monro Inc | Morgan Stanley | 3.420 |
| 10.381 | Modine Manufacturing Co | Bank of America | | (3.104) | Monro Inc | Barclays Bank | 42.593 |
| | | Merrill Lynch | 66.750 | (11.292) | Monster Beverage Corp | HSBC | 12.647 |
| 7.884 | Modine Manufacturing Co | Barclays Bank | 46.516 | (60.354) | Monster Beverage Corp | Morgan Stanley | 72.425 |
| 25.407 | Modine Manufacturing Co | Goldman Sachs | 163.367 | (3.101) | Montauk Renewables Inc | Bank of America | |
| (764) | ModivCare Inc | Barclays Bank | 4.477 | | Montauk Renewables Inc | Merrill Lynch | (1.271) |
| (1.344) | ModivCare Inc | Goldman Sachs | 14.220 | (41.760) | Montauk Renewables Inc | Barclays Bank | (21.298) |
| 15.173 | Moelis & Co 'A' | Barclays Bank | 11.531 | (24.995) | Montauk Renewables Inc | HSBC | (17.996) |
| 2.395 | Moelis & Co 'A' | Goldman Sachs | 7.904 | (16.567) | Montauk Renewables Inc | Morgan Stanley | (7.964) |
| 2.561 | Moelis & Co 'A' | HSBC | 9.890 | (7.208) | Monte Rosa Therapeutics Inc | | |
| 2.293 | Moelis & Co 'A' | Morgan Stanley | 1.743 | (10.533) | Montrose Environmental Group Inc | Morgan Stanley | (4.325) |
| 5.253 | Mohawk Industries Inc | Bank of America | | | Montrose Environmental Group Inc | Barclays Bank | 19.802 |
| | | Merrill Lynch | (13.448) | (10.458) | Montrose Environmental Group Inc | Goldman Sachs | 11.504 |
| 13.589 | Mohawk Industries Inc | Barclays Bank | (39.000) | (5.787) | Montrose Environmental Group Inc | HSBC | (29.572) |
| 1.526 | Mohawk Industries Inc | Goldman Sachs | (2.289) | 895 | Moody's Corp | Bank of America | |
| 1.660 | Mohawk Industries Inc | HSBC | (2.203) | | | Merrill Lynch | 1.119 |
| 4.081 | Mohawk Industries Inc | Morgan Stanley | (11.712) | 10.505 | Moody's Corp | Barclays Bank | (93.935) |
| 1.704 | Molecular Templates Inc | Bank of America | | 510 | Moody's Corp | Goldman Sachs | 638 |
| | | Merrill Lynch | 68 | 2.819 | Moody's Corp | HSBC | 18.014 |
| 5.631 | Molecular Templates Inc | Barclays Bank | (58) | 3.023 | Moody's Corp | Morgan Stanley | (25.272) |
| 38.904 | Molecular Templates Inc | Goldman Sachs | 1.544 | 20.117 | Moog Inc 'A' | Barclays Bank | (42.648) |
| 8.305 | Molecular Templates Inc | HSBC | (61) | 2.187 | Moog Inc 'A' | HSBC | 14.522 |
| 13.598 | Molecular Templates Inc | Morgan Stanley | (140) | (171) | Morgan Group Holding Co | Bank of America | |
| (376) | Molina Healthcare Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (83) |
| | | Merrill Lynch | 8.501 | (47) | Morgan Group Holding Co | Barclays Bank | 10 |
| (2.803) | Molina Healthcare Inc | Barclays Bank | 49.473 | (9) | Morgan Group Holding Co | Goldman Sachs | (4) |
| (4.831) | Molina Healthcare Inc | Goldman Sachs | 109.229 | (69) | Morgan Group Holding Co | HSBC | (33) |
| (4.769) | Molina Healthcare Inc | HSBC | 117.508 | (50) | Morgan Group Holding Co | Morgan Stanley | 10 |
| (1.524) | Molina Healthcare Inc | Morgan Stanley | 26.899 | | | | |
| 5.827 | Molson Coors Beverage Co 'B' | HSBC | (18.413) | | | | |
| 2.193 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Morgan Stanley | (2.500) | | | | |
| (12.831) | Momentive Global Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (907) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (16.995) | Morgan Stanley | Bank of America Merrill Lynch | 6.189 | (26.997) | Mueller Water Products Inc 'A' | HSBC | 21.328 |
| (14.355) | Morgan Stanley | Barclays Bank | (3.431) | 25.162 | Multiplan Corp | Goldman Sachs | 6.291 |
| (74.667) | Morgan Stanley | Goldman Sachs | 31.608 | 24.077 | Multiplan Corp | HSBC | 13.664 |
| (14.820) | Morgan Stanley | HSBC | 27.713 | 30.522 | Murphy Oil Corp | Bank of America Merrill Lynch | 28.080 |
| 102 | Morningstar Inc | Barclays Bank | 504 | 36.205 | Murphy Oil Corp | Barclays Bank | (54.657) |
| (139) | Morningstar Inc | Barclays Bank | (666) | 45.788 | Murphy Oil Corp | Goldman Sachs | 32.579 |
| 334 | Morningstar Inc | Goldman Sachs | 4.466 | 67.896 | Murphy Oil Corp | HSBC | 15.410 |
| (153) | Morningstar Inc | Goldman Sachs | (1.380) | 33.101 | Murphy Oil Corp | Morgan Stanley | (45.445) |
| 551 | Morningstar Inc | HSBC | 10.135 | 1.984 | Murphy USA Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.781) |
| (926) | Morningstar Inc | HSBC | (10.254) | 4.164 | Murphy USA Inc | Barclays Bank | 10.912 |
| 1.438 | Morningstar Inc | Morgan Stanley | 7.104 | 4.204 | Murphy USA Inc | Goldman Sachs | (16.176) |
| (5.131) | Morphic Holding Inc | Barclays Bank | 2.360 | 244 | Murphy USA Inc | HSBC | (1.367) |
| (2.186) | Morphic Holding Inc | Morgan Stanley | 1.006 | 2.154 | Murphy USA Inc | Morgan Stanley | 6.073 |
| (25.332) | Mosaic Co | Bank of America Merrill Lynch | 91.836 | 4.135 | Mustang Bio Inc | Barclays Bank | 8.601 |
| (13.283) | Mosaic Co | Barclays Bank | 45.826 | 4.128 | Mustang Bio Inc | Goldman Sachs | 8.380 |
| (9.612) | Mosaic Co | Goldman Sachs | 39.121 | 7.268 | Mustang Bio Inc | HSBC | 15.735 |
| (14.375) | Mosaic Co | HSBC | 56.252 | 2.501 | MVB Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.057 |
| (8.136) | Mosaic Co | Morgan Stanley | 28.069 | 8.436 | MVB Financial Corp | Barclays Bank | 9.195 |
| (7.844) | Motorcar Parts of America Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.432) | 5.925 | MVB Financial Corp | Goldman Sachs | 4.187 |
| (12.695) | Motorcar Parts of America Inc | Goldman Sachs | (3.935) | 1.049 | MVB Financial Corp | HSBC | 804 |
| (5.434) | Motorcar Parts of America Inc | HSBC | (6.195) | 4.027 | MVB Financial Corp | Morgan Stanley | 50 |
| (3.547) | Motorola Solutions Inc | Barclays Bank | 32.100 | 5.131 | Myers Industries Inc | Barclays Bank | (4.515) |
| 122 | Motorola Solutions Inc | Goldman Sachs | 16 | 7.355 | Myers Industries Inc | Goldman Sachs | (736) |
| 641 | Motorola Solutions Inc | Morgan Stanley | (207) | 16.644 | Myers Industries Inc | HSBC | (999) |
| (4.540) | Movado Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.406) | 1.548 | Myers Industries Inc | Morgan Stanley | (1.362) |
| (3.799) | Movado Group Inc | Barclays Bank | 1.748 | 7.056 | MYR Group Inc | Barclays Bank | (30.623) |
| (1.155) | Movado Group Inc | Goldman Sachs | (612) | 5.387 | MYR Group Inc | Goldman Sachs | (25.265) |
| (15.230) | Movado Group Inc | HSBC | (11.400) | 4.783 | Myriad Genetics Inc | Barclays Bank | 11.862 |
| (3.129) | Movado Group Inc | Morgan Stanley | 1.439 | 10.215 | Myriad Genetics Inc | Goldman Sachs | 38.102 |
| (18.718) | MP Materials Corp | Barclays Bank | 19.466 | (49.605) | N-able Inc | Goldman Sachs | (22.819) |
| (16.435) | MP Materials Corp | Goldman Sachs | 16.932 | (3.252) | N-able Inc | HSBC | (5.919) |
| (5.155) | MP Materials Corp | Morgan Stanley | 5.361 | 2.063 | Nabors Industries Ltd | Barclays Bank | (16.298) |
| (13.231) | Mr Cooper Group Inc | Goldman Sachs | (16.671) | 1.869 | Nabors Industries Ltd | Goldman Sachs | (9.083) |
| (10.573) | Mr Cooper Group Inc | HSBC | (37.640) | 893 | Nabors Industries Ltd | HSBC | (9.037) |
| 14.495 | MRC Global Inc | Barclays Bank | (6.378) | 769 | Nabors Industries Ltd | Morgan Stanley | (6.075) |
| 15.267 | MRC Global Inc | Goldman Sachs | (1.679) | (2.509) | NACCO Industries Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.255) |
| 16.922 | MRC Global Inc | HSBC | (5.077) | (4.328) | NACCO Industries Inc 'A' | Barclays Bank | 3.289 |
| (6.321) | MSA Safety Inc | Barclays Bank | 24.273 | (562) | NACCO Industries Inc 'A' | Goldman Sachs | (281) |
| (1.663) | MSA Safety Inc | HSBC | (9.313) | 7.451 | NanoString Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (18.255) |
| 356 | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 128 | 2.754 | NanoString Technologies Inc | Barclays Bank | (799) |
| 24.082 | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Barclays Bank | (70.560) | 13.759 | NanoString Technologies Inc | HSBC | (36.049) |
| 16.645 | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Goldman Sachs | 5.992 | 4.397 | Nano-X Imaging Ltd | Barclays Bank | (264) |
| 2.459 | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | HSBC | 1.612 | 2.233 | Nano-X Imaging Ltd | HSBC | 31.016 |
| 2.292 | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.716) | 3.246 | Napco Security Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9.348 |
| 1.740 | MSCI Inc | Barclays Bank | (4.854) | 7.738 | Napco Security Technologies Inc | HSBC | 28.089 |
| 601 | MSCI Inc | HSBC | (1.953) | 32.778 | Nasdaq Inc | Bank of America Merrill Lynch | (21.634) |
| 349 | MSCI Inc | Morgan Stanley | (974) | 45.550 | Nasdaq Inc | Barclays Bank | (43.272) |
| (2.166) | Mueller Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 851 | 24.148 | Nasdaq Inc | Goldman Sachs | (15.938) |
| (4.283) | Mueller Industries Inc | Barclays Bank | 10.708 | 11.922 | Nasdaq Inc | HSBC | (4.888) |
| (2.055) | Mueller Industries Inc | HSBC | 3.027 | 36.927 | Nasdaq Inc | Morgan Stanley | (35.081) |
| (3.326) | Mueller Industries Inc | Morgan Stanley | 8.315 | 2.046 | Natera Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.358) |
| (49.794) | Mueller Water Products Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (10.457) | 1.680 | Natera Inc | Goldman Sachs | (759) |
| (98.801) | Mueller Water Products Inc 'A' | Barclays Bank | 5.928 | (821) | Natera Inc | HSBC | 4.355 |
| (13.176) | Mueller Water Products Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.767) | (860) | Natera Inc | Morgan Stanley | 4.545 |
| | | | | (898) | Nathan's Famous Inc | Bank of America Merrill Lynch | 575 |
| | | | | (8.841) | Nathan's Famous Inc | Barclays Bank | (11.228) |
| | | | | (272) | Nathan's Famous Inc | Goldman Sachs | 174 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.188) | Nathan's Famous Inc | Morgan Stanley | (1.509) | 20.720 | Nature's Sunshine Products Inc | Barclays Bank | (4.662) |
| 14.485 | National Bank Holdings Corp 'A' | Barclays Bank | (14.050) | 11.746 | Nature's Sunshine Products Inc | Goldman Sachs | 2.760 |
| 19.893 | National Bank Holdings Corp 'A' | HSBC | 49.534 | 18.267 | Nature's Sunshine Products Inc | Morgan Stanley | (4.110) |
| 5.718 | National Bank Holdings Corp 'A' | Morgan Stanley | (5.546) | 41.516 | Nautilus Biotechnology Inc | Barclays Bank | 23.249 |
| (8.946) | National Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.844 | 25.890 | Nautilus Biotechnology Inc | Goldman Sachs | 11.651 |
| (7.244) | National Bankshares Inc | Barclays Bank | (398) | 18.464 | Nautilus Biotechnology Inc | HSBC | 11.448 |
| (8.732) | National Bankshares Inc | Morgan Stanley | (480) | 11.654 | Nautilus Biotechnology Inc | Morgan Stanley | 6.526 |
| (952) | National Beverage Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.361 | (31.675) | Navient Corp | Barclays Bank | (3.168) |
| (1.456) | National Beverage Corp | Barclays Bank | 2.461 | (29.955) | Navient Corp | Goldman Sachs | (5.392) |
| (2.823) | National Beverage Corp | Goldman Sachs | 7.001 | 6.809 | Navigator Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (272) |
| (1.921) | National Beverage Corp | HSBC | 4.764 | 22.352 | Navigator Holdings Ltd | Barclays Bank | (1.118) |
| (22.753) | National Energy Services Reunited Corp | Barclays Bank | (1.593) | 16.605 | Navigator Holdings Ltd | Goldman Sachs | (664) |
| (4.144) | National Energy Services Reunited Corp | Morgan Stanley | (290) | 7.143 | Navigator Holdings Ltd | HSBC | 1.500 |
| (8.027) | National Fuel Gas Co | Bank of America Merrill Lynch | 7.692 | 5.358 | Navigator Holdings Ltd | Morgan Stanley | (268) |
| (48.676) | National Fuel Gas Co | Barclays Bank | 40.623 | (45.073) | Navitas Semiconductor Corp | Morgan Stanley | 37.636 |
| (13.525) | National Fuel Gas Co | Goldman Sachs | 11.767 | (1.581) | NBT Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.075) |
| (4.337) | National Fuel Gas Co | HSBC | 5.320 | (4.262) | NBT Bancorp Inc | Barclays Bank | 5.839 |
| (26.073) | National Fuel Gas Co | Morgan Stanley | 21.902 | (594) | NBT Bancorp Inc | HSBC | (1.224) |
| (15.155) | National Health Investors Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 20.156 | (3.533) | NBT Bancorp Inc | Morgan Stanley | 4.507 |
| (5.921) | National Health Investors Inc (REIT) | Barclays Bank | 237 | (14.821) | nCino Inc | Bank of America Merrill Lynch | (62.100) |
| (20.791) | National Health Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | 27.652 | (12.983) | nCino Inc | Barclays Bank | (6.622) |
| (6.096) | National Health Investors Inc (REIT) | HSBC | (14.265) | (13.809) | nCino Inc | Goldman Sachs | (57.860) |
| 6.496 | National HealthCare Corp | Bank of America Merrill Lynch | 7.535 | (24.165) | nCino Inc | HSBC | (131.458) |
| 5.663 | National HealthCare Corp | Barclays Bank | (170) | (8.246) | nCino Inc | Morgan Stanley | (4.205) |
| 54 | National HealthCare Corp | Goldman Sachs | 63 | 1.857 | NCR Corp | Bank of America Merrill Lynch | (93) |
| 6.791 | National HealthCare Corp | HSBC | 18.064 | 2.751 | NCR Corp | Barclays Bank | (1.596) |
| 3.143 | National HealthCare Corp | Morgan Stanley | (94) | 10.707 | NCR Corp | HSBC | 12.848 |
| (3.934) | National Presto Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.773) | 41.325 | Nektar Therapeutics | Bank of America Merrill Lynch | (5.724) |
| (6.555) | National Presto Industries Inc | Barclays Bank | (66) | 47.630 | Nektar Therapeutics | Barclays Bank | (4.920) |
| (6.351) | National Presto Industries Inc | HSBC | (39.884) | 109.831 | Nektar Therapeutics | Goldman Sachs | (15.212) |
| 4.397 | National Research Corp | Barclays Bank | (616) | 74.443 | Nektar Therapeutics | HSBC | (10.801) |
| (30.932) | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Barclays Bank | 21.287 | 120.549 | Nektar Therapeutics | Morgan Stanley | (12.453) |
| 6.252 | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Barclays Bank | (5.002) | 453 | Nelnet Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (711) |
| (4.840) | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Goldman Sachs | 6.437 | 8.289 | Nelnet Inc 'A' | Barclays Bank | (18.650) |
| (4.977) | National Storage Affiliates Trust (REIT) | HSBC | 6.171 | 2.449 | Nelnet Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.101) |
| 12.402 | National Vision Holdings Inc | HSBC | 37.826 | 624 | Nelnet Inc 'A' | Morgan Stanley | (404) |
| (1.788) | National Western Life Group Inc 'A' | Barclays Bank | 15.654 | 2.642 | Neogen Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.319 |
| (1.883) | National Western Life Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (213.109) | (1.066) | Neogen Corp | Bank of America Merrill Lynch | (18) |
| 23.191 | Natural Gas Services Group Inc | Morgan Stanley | (9.972) | (67.234) | Neogen Corp | Barclays Bank | (59.166) |
| 9.244 | Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc | Barclays Bank | (1.479) | (6.705) | Neogen Corp | Goldman Sachs | (3.285) |
| 5.281 | Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc | Goldman Sachs | 1.003 | (10.032) | Neogen Corp | Morgan Stanley | (8.828) |
| 3.802 | Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc | HSBC | 1.597 | 2.101 | NeoGenomics Inc | Barclays Bank | (2.962) |
| 19.911 | Nature's Sunshine Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.679 | (6.750) | NerdWallet Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.856 |
| | | | | (6.425) | Nerdy Inc | Barclays Bank | 3.020 |
| | | | | (60.813) | Nerdy Inc | Morgan Stanley | 28.582 |
| | | | | (3.328) | NetApp Inc | Morgan Stanley | 4.526 |
| | | | | (1.477) | Netflix Inc | Bank of America Merrill Lynch | (84.391) |
| | | | | (607) | Netflix Inc | Barclays Bank | (18.824) |
| | | | | (172) | Netflix Inc | Goldman Sachs | (10.029) |
| | | | | (1.359) | Netflix Inc | HSBC | (62.110) |
| | | | | (174) | Netflix Inc | Morgan Stanley | (5.427) |
| | | | | (2.994) | NETGEAR Inc | Bank of America Merrill Lynch | 165 |
| | | | | (4.639) | NETGEAR Inc | Barclays Bank | (302) |
| | | | | (8.843) | NETGEAR Inc | Morgan Stanley | (575) |
| | | | | (4.474) | NetScout Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.832) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.713) | NetScout Systems Inc | Barclays Bank | 942 | (2.374) | NewMarket Corp | HSBC | (42.984) |
| (5.301) | NetScout Systems Inc | Goldman Sachs | (5.725) | (1.357) | NewMarket Corp | Morgan Stanley | 2.633 |
| (3.463) | NetScout Systems Inc | HSBC | (5.430) | 39.932 | Newmont Corp | Barclays Bank | (127.782) |
| (2.121) | NetScout Systems Inc | Morgan Stanley | 1.167 | 591 | Newmont Corp | Morgan Stanley | (1.891) |
| (9.676) | NETSTREIT Corp (REIT) | Bank of America | | 20.617 | Newpark Resources Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.888 | | | Merrill Lynch | (6.185) |
| (66.938) | NETSTREIT Corp (REIT) | Barclays Bank | 42.171 | 53.960 | Newpark Resources Inc | Barclays Bank | (21.584) |
| (49.307) | NETSTREIT Corp (REIT) | Goldman Sachs | 30.570 | 61.750 | Newpark Resources Inc | HSBC | (22.230) |
| (20.718) | NETSTREIT Corp (REIT) | HSBC | 11.001 | 8.494 | Newpark Resources Inc | Morgan Stanley | (3.398) |
| (8.245) | NETSTREIT Corp (REIT) | Morgan Stanley | 5.194 | (135.223) | News Corp 'A' | Barclays Bank | (12.846) |
| 3.112 | Neurocrine Biosciences Inc | Bank of America | | (42.207) | News Corp 'A' | Goldman Sachs | 6.120 |
| | | Merrill Lynch | (22.998) | (84.179) | News Corp 'A' | HSBC | (125.006) |
| 8.695 | Neurocrine Biosciences Inc | Barclays Bank | (23.825) | (105.910) | News Corp 'A' | Morgan Stanley | (10.737) |
| 1.559 | Neurocrine Biosciences Inc | Goldman Sachs | (10.494) | 1.096 | News Corp 'B' | Goldman Sachs | (132) |
| 5.723 | Neurocrine Biosciences Inc | HSBC | (39.525) | 30.481 | News Corp 'B' | HSBC | 45.112 |
| 10.541 | Neurocrine Biosciences Inc | Morgan Stanley | (28.882) | 10.484 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| 118 | NeuroPace Inc | Barclays Bank | (30) | | | Merrill Lynch | (3.460) |
| 1.961 | Nevro Corp | Bank of America | | 7.866 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (4.090) |
| | | Merrill Lynch | (1.252) | 5.333 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.760) |
| 818 | Nevro Corp | Barclays Bank | (425) | 6.700 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | HSBC | (6.499) |
| 3.063 | Nevro Corp | HSBC | (1.838) | 4.321 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (2.247) |
| 4.310 | Nevro Corp | Morgan Stanley | (2.241) | 5.279 | Nexstar Media Group Inc | Barclays Bank | (52.157) |
| (5.034) | New Fortress Energy Inc | Bank of America | | (5.111) | Nexstar Media Group Inc | HSBC | 77.994 |
| | | Merrill Lynch | 5.913 | 1.120 | Nexstar Media Group Inc | HSBC | (17.091) |
| (5.089) | New Fortress Energy Inc | Barclays Bank | 11.545 | 67.453 | NextCure Inc | Barclays Bank | (7.420) |
| (4.732) | New Fortress Energy Inc | Goldman Sachs | 15.758 | 9.126 | NextCure Inc | Goldman Sachs | 365 |
| (3.140) | New Fortress Energy Inc | HSBC | 7.765 | 17.352 | NextCure Inc | HSBC | 2.082 |
| (10.354) | New Fortress Energy Inc | Morgan Stanley | 24.125 | (33.509) | NextDecade Corp | Barclays Bank | 16.754 |
| 10.759 | New Jersey Resources Corp | Bank of America | | (54.063) | NextDecade Corp | Morgan Stanley | 27.031 |
| | | Merrill Lynch | (11.117) | (8.738) | NextEra Energy Inc | Bank of America | |
| 42.600 | New Jersey Resources Corp | Barclays Bank | (33.654) | | | Merrill Lynch | 43.132 |
| 83.674 | New Jersey Resources Corp | Goldman Sachs | (85.879) | (50.984) | NextEra Energy Inc | Barclays Bank | 121.852 |
| 54.201 | New Jersey Resources Corp | HSBC | (77.132) | (13.282) | NextEra Energy Inc | Goldman Sachs | 71.059 |
| 82.027 | New Jersey Resources Corp | Morgan Stanley | (61.657) | (14.773) | NextEra Energy Inc | HSBC | 57.172 |
| (3.021) | New Jersey Resources Corp | Morgan Stanley | 2.387 | (5.209) | NextEra Energy Inc | Morgan Stanley | 12.450 |
| (385) | New Relic Inc | Barclays Bank | 3.280 | (3.615) | NextEra Energy Partners LP | Bank of America | |
| (785) | New Relic Inc | Morgan Stanley | 9.616 | (2.367) | NextEra Energy Partners LP | Merrill Lynch | (3.893) |
| (14.366) | New York Community Bancorp Inc | Bank of America | | 642 | NextEra Energy Partners LP | HSBC | (838) |
| | | Merrill Lynch | (1.293) | 15.427 | NextGen Healthcare Inc | HSBC | (732) |
| (26.763) | New York Community Bancorp Inc | Barclays Bank | 13.382 | 12.999 | NextGen Healthcare Inc | Bank of America | |
| (53.114) | New York Community Bancorp Inc | Goldman Sachs | (4.780) | 46.618 | NextGen Healthcare Inc | Merrill Lynch | (19.901) |
| 20.019 | New York Community Bancorp Inc | Goldman Sachs | 1.802 | 6.545 | NextGen Healthcare Inc | Barclays Bank | (1.820) |
| (50.856) | New York Community Bancorp Inc | Morgan Stanley | 25.428 | (5.433) | NextGen Healthcare Inc | Goldman Sachs | (60.137) |
| (4.899) | New York Mortgage Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 1.176 | | NexTier Oilfield Solutions Inc | Morgan Stanley | (916) |
| (2.695) | New York Times Co 'A' | Barclays Bank | 2.439 | (41.710) | NexTier Oilfield Solutions Inc | Bank of America | |
| (844) | New York Times Co 'A' | Goldman Sachs | 781 | (13.131) | NexTier Oilfield Solutions Inc | Merrill Lynch | (163) |
| (8.937) | New York Times Co 'A' | HSBC | 37.401 | (36.586) | NexTier Oilfield Solutions Inc | Barclays Bank | 24.192 |
| (2.664) | New York Times Co 'A' | Morgan Stanley | 2.411 | (20.424) | NexTier Oilfield Solutions Inc | Goldman Sachs | (394) |
| 6.203 | Newegg Commerce Inc | Barclays Bank | (930) | | NexTier Oilfield Solutions Inc | HSBC | 2.561 |
| 16.945 | Newegg Commerce Inc | HSBC | (847) | (45.499) | NextNav Inc | Morgan Stanley | 11.846 |
| (67.431) | Newell Brands Inc | Barclays Bank | 31.018 | (10.179) | NEXTracker Inc 'A' | HSBC | (20.020) |
| (97.293) | Newell Brands Inc | Goldman Sachs | 78.807 | (2.817) | NEXTracker Inc 'A' | Bank of America | |
| (15.989) | Newell Brands Inc | HSBC | 26.702 | 8.000 | NEXTracker Inc 'A' | Merrill Lynch | 15.370 |
| (69.506) | Newell Brands Inc | Morgan Stanley | 31.973 | (17.657) | NEXTracker Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.254 |
| (61.983) | Newmark Group Inc 'A' | Bank of America | | 22.391 | NGM Biopharmaceuticals Inc | HSBC | 52.640 |
| | | Merrill Lynch | 10.969 | | | Morgan Stanley | 20.658 |
| (13.903) | Newmark Group Inc 'A' | HSBC | 3.498 | 9.938 | NGM Biopharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (7.613) |
| (48.567) | Newmark Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 11.020 | 10.927 | NI Holdings Inc | Barclays Bank | |
| (4.076) | NewMarket Corp | Barclays Bank | 7.594 | | | Merrill Lynch | 164 |
| (2.563) | NewMarket Corp | Goldman Sachs | (2.973) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 12.084 | NI Holdings Inc | Barclays Bank | 4.411 | (7.723) | Nordson Corp | Goldman Sachs | (12.434) |
| 25.910 | NI Holdings Inc | Goldman Sachs | 389 | 2.648 | Nordson Corp | Goldman Sachs | 4.263 |
| 19.239 | NI Holdings Inc | HSBC | 2.597 | (2.738) | Nordson Corp | HSBC | (1.506) |
| 6.375 | NI Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.327 | 2.697 | Nordson Corp | HSBC | 1.483 |
| (1.114) | Nicolet Bankshares Inc | Bank of America | | (735) | Nordson Corp | Morgan Stanley | (1.588) |
| | | Merrill Lynch | (10.394) | 3.852 | Nordson Corp | Morgan Stanley | 8.320 |
| (15.647) | Nicolet Bankshares Inc | Barclays Bank | (30.512) | (8.092) | Nordstrom Inc | Morgan Stanley | 1.925 |
| (8.125) | Nicolet Bankshares Inc | Goldman Sachs | (75.806) | 9.415 | Norfolk Southern Corp | Bank of America | |
| (15.449) | Nicolet Bankshares Inc | HSBC | (128.999) | | | Merrill Lynch | (47.546) |
| (1.426) | Nicolet Bankshares Inc | Morgan Stanley | (2.781) | 15.361 | Norfolk Southern Corp | Barclays Bank | (159.294) |
| 2.552 | NIKE Inc 'B' | Morgan Stanley | (11.254) | 30 | Norfolk Southern Corp | Goldman Sachs | (152) |
| 17.975 | Nikola Corp | HSBC | (6.680) | 2.260 | Norfolk Southern Corp | HSBC | 1.785 |
| 4.603 | Nikola Corp | Morgan Stanley | (917) | 9.223 | Norfolk Southern Corp | Morgan Stanley | (95.643) |
| (30.670) | Nine Energy Service Inc | Bank of America | | (3.597) | Northeast Bank | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.534 | | | Merrill Lynch | 432 |
| (25.562) | Nine Energy Service Inc | Barclays Bank | 10.480 | (927) | Northeast Bank | Barclays Bank | 658 |
| (1.392) | Nine Energy Service Inc | HSBC | 1.281 | (3.033) | Northeast Bank | Goldman Sachs | 364 |
| (33.604) | Nine Energy Service Inc | Morgan Stanley | 13.778 | (5.236) | Northeast Bank | HSBC | (7.697) |
| 41.930 | NiSource Inc | Bank of America | | (913) | Northeast Bank | Morgan Stanley | 648 |
| | | Merrill Lynch | (63.524) | (49.012) | Northeast Community Bancorp Inc | | |
| (12.219) | NiSource Inc | Bank of America | | (29.798) | Northern Oil and Gas Inc | Goldman Sachs | (16.174) |
| | | Merrill Lynch | 18.512 | (33.010) | Northern Oil and Gas Inc | Barclays Bank | 47.379 |
| 121.219 | NiSource Inc | Barclays Bank | (104.854) | 594 | Northern Technologies International Corp | HSBC | 55.787 |
| (2.799) | NiSource Inc | Barclays Bank | 2.421 | | | Goldman Sachs | 140 |
| (1.041) | NiSource Inc | HSBC | 2.004 | 4.645 | Northern Technologies International Corp | Morgan Stanley | 1.370 |
| 42.099 | NiSource Inc | Morgan Stanley | (36.416) | (10.597) | Northern Trust Corp | Bank of America | |
| (3.362) | NiSource Inc | Morgan Stanley | 2.908 | | | Merrill Lynch | (12.081) |
| 12.433 | Nkarta Inc | Bank of America | | 3.294 | Northern Trust Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 373 | (9.042) | Northern Trust Corp | Merrill Lynch | 3.755 |
| 36.702 | Nkarta Inc | Barclays Bank | 10.277 | (5.024) | Northern Trust Corp | Barclays Bank | 9.494 |
| 20.875 | Nkarta Inc | Goldman Sachs | 626 | 3.716 | Northern Trust Corp | HSBC | (3.865) |
| 21.722 | Nkarta Inc | HSBC | 1.955 | (4.076) | Northern Trust Corp | Morgan Stanley | 4.280 |
| (35.339) | NL Industries Inc | Bank of America | | 1.539 | Northern Trust Corp | Morgan Stanley | (1.616) |
| | | Merrill Lynch | 5.301 | (90.105) | Northfield Bancorp Inc | Bank of America | |
| (2.310) | NL Industries Inc | Barclays Bank | 208 | | | Merrill Lynch | (67.579) |
| (21.055) | NL Industries Inc | Goldman Sachs | 3.158 | (32.496) | Northfield Bancorp Inc | Barclays Bank | (1.300) |
| (527) | nLight Inc | Bank of America | | (40.622) | Northfield Bancorp Inc | Goldman Sachs | (30.467) |
| | | Merrill Lynch | (806) | (9.795) | Northfield Bancorp Inc | HSBC | (6.857) |
| (7.732) | nLight Inc | Barclays Bank | (2.861) | (11.044) | Northfield Bancorp Inc | Morgan Stanley | (442) |
| (16.396) | nLight Inc | Goldman Sachs | (25.086) | 23.971 | Northrim BanCorp Inc | Barclays Bank | 3.116 |
| (11.697) | nLight Inc | HSBC | (20.236) | 11.553 | Northrim BanCorp Inc | Goldman Sachs | 25.763 |
| (4.295) | nLight Inc | Morgan Stanley | (1.589) | 4.454 | Northrim BanCorp Inc | HSBC | 7.483 |
| 22.721 | NMI Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 12.269 | (51.985) | Northwest Bancshares Inc | Barclays Bank | 8.318 |
| 10.207 | NMI Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 16.739 | (10.519) | Northwest Natural Holding Co | Bank of America | |
| 7.397 | NMI Holdings Inc 'A' | HSBC | 11.835 | | | Merrill Lynch | 22.511 |
| (3.594) | NNN Inc (REIT) | Bank of America | | (4.650) | Northwest Natural Holding Co | Barclays Bank | 8.556 |
| | | Merrill Lynch | 6.865 | (11.787) | Northwest Natural Holding Co | HSBC | 44.422 |
| (12.998) | NNN Inc (REIT) | Barclays Bank | 8.839 | (1.497) | Northwest Natural Holding Co | Morgan Stanley | 2.754 |
| (8.087) | NNN Inc (REIT) | Goldman Sachs | 15.446 | (13.722) | Northwest Pipe Co | Barclays Bank | 11.801 |
| (13.013) | NNN Inc (REIT) | HSBC | 31.464 | (2.541) | Northwest Pipe Co | Goldman Sachs | (1.601) |
| (7.216) | NNN Inc (REIT) | Morgan Stanley | 4.907 | (757) | Northwest Pipe Co | Morgan Stanley | 651 |
| (7.241) | Noble Corp Plc | Bank of America | | (35.858) | NorthWestern Corp | Barclays Bank | 44.822 |
| | | Merrill Lynch | (6.082) | (29.499) | NorthWestern Corp | HSBC | 83.187 |
| (45.470) | Noble Corp Plc | Barclays Bank | 56.433 | (27.453) | NorthWestern Corp | Morgan Stanley | 34.316 |
| (60.769) | Noble Corp Plc | HSBC | (74.568) | (3.152) | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | HSBC | (1.544) |
| (51.748) | Noble Corp Plc | Morgan Stanley | 62.101 | (2.074) | Norwood Financial Corp | Barclays Bank | 1.867 |
| 18.111 | Noodles & Co | Bank of America | | (214) | Norwood Financial Corp | HSBC | 345 |
| | | Merrill Lynch | (9.599) | (860) | Norwood Financial Corp | Morgan Stanley | 774 |
| 37.871 | Noodles & Co | Barclays Bank | — | 8.587 | NOV Inc | Bank of America | |
| 24.330 | Noodles & Co | Goldman Sachs | (12.895) | | | Merrill Lynch | (7.127) |
| 16.703 | Noodles & Co | HSBC | (23.802) | 53.097 | NOV Inc | Barclays Bank | (53.945) |
| 5.872 | Noodles & Co | Morgan Stanley | — | 14.403 | NOV Inc | Goldman Sachs | (11.954) |
| 80.003 | Nordic American Tankers Ltd | Goldman Sachs | (2.400) | 19.319 | NOV Inc | HSBC | (27.851) |
| | | Morgan Stanley | (1.366) | | | | |
| 2.846 | Nordic American Tankers Ltd | Bank of America | | | | | |
| (2.512) | Nordson Corp | Merrill Lynch | (4.044) | | | | |
| (10.933) | Nordson Corp | Barclays Bank | (23.615) | | | | |
| 2.213 | Nordson Corp | Barclays Bank | 4.780 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 8.163 | NOV Inc | Morgan Stanley | (9.301) | 1.356 | NVIDIA Corp | Goldman Sachs | 145.567 |
| 121.140 | Novagold Resources Inc | Barclays Bank | (48.456) | 4.776 | NVIDIA Corp | HSBC | 504.322 |
| 126.423 | Novagold Resources Inc | Goldman Sachs | (56.890) | 6.361 | NVIDIA Corp | Morgan Stanley | 549.165 |
| 39.585 | Novagold Resources Inc | HSBC | (18.605) | 49 | NVR Inc | Barclays Bank | (5.488) |
| 4.521 | Novagold Resources Inc | Morgan Stanley | (1.808) | 55 | NVR Inc | HSBC | (16.735) |
| (8.789) | Novanta Inc | Bank of America | | 27 | NVR Inc | Morgan Stanley | (3.024) |
| | | Merrill Lynch | (24.082) | 10.655 | NXP Semiconductors NV | Bank of America | |
| (9.582) | Novanta Inc | Barclays Bank | 8.912 | | | Merrill Lynch | 138.728 |
| (4.344) | Novanta Inc | Goldman Sachs | (11.902) | 8.071 | NXP Semiconductors NV | Barclays Bank | 28.894 |
| (5.703) | Novanta Inc | HSBC | (32.963) | 5.920 | NXP Semiconductors NV | Goldman Sachs | 77.078 |
| (882) | Novanta Inc | Morgan Stanley | 820 | 1.213 | NXP Semiconductors NV | HSBC | 15.648 |
| (511) | Novocure Ltd | Bank of America | | 8.376 | NXP Semiconductors NV | Morgan Stanley | 29.986 |
| | | Merrill Lynch | 134 | 354 | Nymox Pharmaceutical Corp | Bank of America | |
| (3.451) | Novocure Ltd | Barclays Bank | 23.867 | | | Merrill Lynch | 17 |
| (1.503) | Novocure Ltd | Goldman Sachs | 6.809 | 17.982 | Nymox Pharmaceutical Corp | Goldman Sachs | 879 |
| (4.402) | Novocure Ltd | HSBC | (12.191) | 46.926 | Nymox Pharmaceutical Corp | Morgan Stanley | 826 |
| (6.859) | Novocure Ltd | Morgan Stanley | 49.986 | 6.280 | Oak Valley Bancorp | Barclays Bank | (1.821) |
| 6.025 | NOW Inc | Bank of America | | 8.952 | Oak Valley Bancorp | Goldman Sachs | 1.880 |
| | | Merrill Lynch | (1.506) | 5.011 | Oak Valley Bancorp | HSBC | (3.458) |
| 4.783 | NOW Inc | Barclays Bank | (2.200) | (8.187) | Occidental Petroleum Corp | Bank of America | |
| 9.030 | NOW Inc | Goldman Sachs | (2.258) | (13.760) | Occidental Petroleum Corp | Merrill Lynch | 5.331 |
| 41.253 | NOW Inc | HSBC | (16.914) | (10.931) | Occidental Petroleum Corp | Barclays Bank | 16.321 |
| 4.064 | NOW Inc | Morgan Stanley | (1.869) | (24.852) | Occidental Petroleum Corp | Goldman Sachs | 6.559 |
| 1.392 | NRG Energy Inc | Bank of America | | (19.395) | Occidental Petroleum Corp | HSBC | 25.444 |
| | | Merrill Lynch | (529) | (13.891) | Occidental Petroleum Corp | Morgan Stanley | 21.846 |
| 2.415 | NRG Energy Inc | Barclays Bank | (1.521) | | Oceaneering International Inc | HSBC | 22.781 |
| 4.881 | NRG Energy Inc | Morgan Stanley | (3.075) | 2.112 | OceanFirst Financial Corp | Bank of America | |
| (16.375) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 2.492 |
| | | Merrill Lynch | 61.734 | 134.539 | OceanFirst Financial Corp | Barclays Bank | (32.289) |
| (5.591) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Barclays Bank | 11.238 | 1.826 | OceanFirst Financial Corp | Goldman Sachs | 2.155 |
| (5.252) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | HSBC | 23.844 | 35.307 | OceanFirst Financial Corp | HSBC | 26.833 |
| (11.764) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Morgan Stanley | 23.646 | 4.191 | OceanFirst Financial Corp | Morgan Stanley | (1.006) |
| (5.670) | Nucor Corp | Barclays Bank | 54.752 | (662) | Oconee Federal Financial Corp | | |
| (9.024) | Nucor Corp | HSBC | 103.866 | (12.789) | Ocular Therapeutix Inc | Barclays Bank | 1.109 |
| (1.095) | Nucor Corp | Morgan Stanley | 10.786 | (7.197) | Ocular Therapeutix Inc | Barclays Bank | 1.790 |
| 4.670 | Nurix Therapeutics Inc | Barclays Bank | (887) | (1.337) | Ocwen Financial Corp | HSBC | 216 |
| 28.167 | Nurix Therapeutics Inc | HSBC | 13.520 | | | Bank of America | |
| 7.822 | Nurix Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.486) | (1.470) | Ocwen Financial Corp | Merrill Lynch | 2.126 |
| (7.703) | NuScale Power Corp | Barclays Bank | 5.546 | (747) | Ocwen Financial Corp | Barclays Bank | 1.220 |
| 15.479 | Nutanix Inc 'A' | Bank of America | | (2.041) | Ocwen Financial Corp | Goldman Sachs | 1.188 |
| | | Merrill Lynch | 53.093 | (982) | ODP Corp | Morgan Stanley | 1.694 |
| 11.340 | Nutanix Inc 'A' | Barclays Bank | 42.979 | | | Bank of America | |
| (6.585) | Nutanix Inc 'A' | HSBC | (22.828) | (21.880) | Office Properties Income Trust (REIT) | Merrill Lynch | 1.306 |
| (7.105) | Nutanix Inc 'A' | Morgan Stanley | (26.928) | (23.890) | Office Properties Income Trust (REIT) | Barclays Bank | (9.556) |
| (743) | Nuvalent Inc 'A' | Bank of America | | (17.032) | Office Properties Income Trust (REIT) | HSBC | (15.329) |
| | | Merrill Lynch | (119) | (51.013) | Office Properties Income Trust (REIT) | Morgan Stanley | (20.405) |
| (3.787) | Nuvalent Inc 'A' | HSBC | (11.891) | (3.248) | OFG Bancorp | HSBC | (4.385) |
| (6.926) | Nuvalent Inc 'A' | Morgan Stanley | (970) | 1.385 | OGE Energy Corp | Bank of America | |
| 49.573 | Nuvation Bio Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (3.144) |
| | | Merrill Lynch | (3.470) | 25.110 | OGE Energy Corp | Barclays Bank | (31.639) |
| 52.011 | Nuvation Bio Inc | Barclays Bank | (6.761) | 916 | OGE Energy Corp | Goldman Sachs | (2.079) |
| 66.090 | Nuvation Bio Inc | Goldman Sachs | (4.626) | 12.574 | OGE Energy Corp | HSBC | (32.818) |
| 109.629 | Nuvation Bio Inc | HSBC | (5.481) | 23.593 | OGE Energy Corp | Morgan Stanley | (29.727) |
| 29.223 | Nuvation Bio Inc | Morgan Stanley | (3.799) | (1.627) | Ohio Valley Banc Corp | Bank of America | |
| (2.788) | NV5 Global Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 98 |
| | | Merrill Lynch | (115) | (1.009) | Ohio Valley Banc Corp | Morgan Stanley | 262 |
| (2.550) | NV5 Global Inc | Barclays Bank | 3.953 | (22.188) | O-I Glass Inc | Barclays Bank | 22.632 |
| (3.344) | NV5 Global Inc | Goldman Sachs | (2.642) | 46.920 | Oil States International Inc | Barclays Bank | (29.560) |
| (5.810) | NV5 Global Inc | HSBC | 11.888 | 27.564 | Oil States International Inc | Goldman Sachs | (9.372) |
| (3.896) | NV5 Global Inc | Morgan Stanley | 6.163 | 10.348 | Oil States International Inc | HSBC | (4.450) |
| (4.665) | NVE Corp | Barclays Bank | 1.959 | 3.790 | Oil-Dri Corp of America | Bank of America | |
| 6.749 | nVent Electric Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (15.198) |
| | | Merrill Lynch | 19.572 | | | | |
| 28.497 | nVent Electric Plc | Barclays Bank | 37.331 | | | | |
| 6.582 | nVent Electric Plc | Goldman Sachs | 19.088 | | | | |
| 517 | nVent Electric Plc | HSBC | 1.592 | | | | |
| 12.984 | nVent Electric Plc | Morgan Stanley | 15.899 | | | | |
| 925 | NVIDIA Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 99.299 | | | | |
| 6.037 | NVIDIA Corp | Barclays Bank | 516.883 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.408 | Oil-Dri Corp of America | Barclays Bank | (2.697) | 2.706 | Omega Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (2.435) |
| 2.308 | Oil-Dri Corp of America | Goldman Sachs | (9.255) | 306 | Omega Therapeutics Inc | HSBC | (364) |
| 1.267 | Oil-Dri Corp of America | HSBC | (3.824) | 20.527 | Omeros Corp | Barclays Bank | (9.750) |
| 723 | Oil-Dri Corp of America | Morgan Stanley | (810) | (570) | Omniab Inc* | Bank of America | |
| (214) | Okta Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 570 |
| | | Merrill Lynch | (2.658) | (570) | Omniab Inc* | Bank of America | |
| (2.965) | Okta Inc | Barclays Bank | (12.734) | | | Merrill Lynch | 570 |
| (1.032) | Okta Inc | HSBC | (12.953) | (653) | Omniab Inc** | Barclays Bank | — |
| (3.942) | Okta Inc | Morgan Stanley | (21.129) | (653) | Omniab Inc** | Barclays Bank | — |
| (7.262) | Olaplex Holdings Inc | Barclays Bank | 1.561 | (317) | Omniab Inc* | HSBC | — |
| (490) | Old Dominion Freight Line Inc | Barclays Bank | (3.067) | (317) | Omniab Inc* | HSBC | — |
| (4.799) | Old Dominion Freight Line Inc | Goldman Sachs | (8.292) | (279) | Omniab Inc* | Morgan Stanley | — |
| (3.796) | Old Dominion Freight Line Inc | HSBC | 12.261 | (279) | Omniab Inc* | Morgan Stanley | — |
| 161.598 | Old National Bancorp | Barclays Bank | (54.943) | (60) | OmniAb Inc | Bank of America | |
| (3.064) | Old National Bancorp | Barclays Bank | 896 | (8.442) | OmniAb Inc | Merrill Lynch | (45) |
| 1.439 | Old National Bancorp | Goldman Sachs | 230 | (4.105) | OmniAb Inc | Barclays Bank | (2.026) |
| (6.480) | Old National Bancorp | Goldman Sachs | 2.219 | 5 | Omnicell Inc | HSBC | (3.325) |
| 2.368 | Old National Bancorp | HSBC | 355 | | | Bank of America | |
| (27.182) | Old Republic International Corp | Bank of America | | 8.126 | Omnicell Inc | Merrill Lynch | 27 |
| (75.130) | Old Republic International Corp | Merrill Lynch | 26.095 | (2.884) | Omnicom Group Inc | Morgan Stanley | 6.663 |
| (41.652) | Old Republic International Corp | Barclays Bank | 35.311 | (6.628) | Omnicom Group Inc | Barclays Bank | 7.643 |
| (16.293) | Old Republic International Corp | Goldman Sachs | 37.885 | (7.875) | Omnicom Group Inc | Goldman Sachs | 10.406 |
| (53.693) | Old Republic International Corp | HSBC | 10.802 | (4.614) | Omnicom Group Inc | HSBC | 14.411 |
| 31.191 | Old Second Bancorp Inc | Morgan Stanley | 25.236 | (8.434) | ON Semiconductor Corp | Morgan Stanley | 12.227 |
| 4.290 | Old Second Bancorp Inc | Barclays Bank | (6.862) | 244 | ON Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (11.344) |
| 2.216 | Olema Pharmaceuticals Inc | Bank of America | (944) | (14.482) | ON Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (59) |
| | | Merrill Lynch | (2.925) | 12.779 | ON24 Inc | HSBC | (46.560) |
| 3.827 | Olema Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (3.329) | 1.607 | ON24 Inc | Barclays Bank | 10.223 |
| 22.059 | Olema Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (29.118) | (12.359) | ON24 Inc | HSBC | (804) |
| 10.150 | Olema Pharmaceuticals Inc | HSBC | (12.180) | (14.620) | Oncocyte Corp | Goldman Sachs | 569 |
| 26.186 | Olema Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (22.782) | (32.664) | Oncocyte Corp | HSBC | 703 |
| (5.550) | Olin Corp | Bank of America | | 7.986 | Oncocyte Corp | Morgan Stanley | 526 |
| | | Merrill Lynch | 28.196 | 9.055 | Oncorus Inc | Barclays Bank | (1.063) |
| (20.242) | Olin Corp | Barclays Bank | 122.262 | 2.097 | Oncorus Inc | Goldman Sachs | (1.187) |
| (12.492) | Olin Corp | HSBC | 68.508 | (226.201) | Ondas Holdings Inc | Morgan Stanley | (279) |
| (8.475) | Olin Corp | Morgan Stanley | 29.410 | | | Bank of America | |
| (12.172) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Goldman Sachs | 139.126 | (12.840) | Ondas Holdings Inc | Merrill Lynch | 26.081 |
| (721) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | HSBC | 9.553 | (10.473) | ONE Gas Inc | Barclays Bank | 1.283 |
| (864) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Morgan Stanley | 7.154 | (23.787) | ONE Gas Inc | Bank of America | (8.964) |
| (18.485) | Olo Inc 'A' | Goldman Sachs | 12.755 | (12.201) | ONE Gas Inc | Merrill Lynch | (13.577) |
| (8.170) | Olo Inc 'A' | HSBC | 899 | (8.005) | ONE Gas Inc | Barclays Bank | (10.629) |
| (17.406) | Olo Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.089 | (17.797) | One Liberty Properties Inc (REIT) | HSBC | (4.723) |
| (2.941) | Olympic Steel Inc | Bank of America | | (11.046) | One Liberty Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | |
| | | Merrill Lynch | 588 | 25.129 | OneMain Holdings Inc | Barclays Bank | 8.899 |
| (1.003) | Olympic Steel Inc | HSBC | 1.204 | | | Goldman Sachs | 331 |
| (3.113) | Olympic Steel Inc | Morgan Stanley | 8.467 | 2.751 | OneMain Holdings Inc | Bank of America | |
| (1.324) | Omega Flex Inc | Bank of America | | 3.335 | OneMain Holdings Inc | Merrill Lynch | 43.976 |
| | | Merrill Lynch | (79) | 3.559 | OneMain Holdings Inc | Barclays Bank | 1.801 |
| (433) | Omega Flex Inc | Barclays Bank | 1.472 | 9.653 | OneMain Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.628 |
| (531) | Omega Flex Inc | Goldman Sachs | (32) | 4.215 | ONEOK Inc | HSBC | 8.008 |
| (504) | Omega Flex Inc | HSBC | 4.647 | (19.875) | OneSpan Inc | Morgan Stanley | 6.575 |
| (810) | Omega Flex Inc | Morgan Stanley | 2.754 | (19.465) | OneSpan Inc | Morgan Stanley | (6.786) |
| (69.863) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Barclays Bank | (698) | 36.814 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Barclays Bank | (3.379) |
| (84.292) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | 49.732 | 18.956 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Goldman Sachs | (19.660) |
| | | HSBC | (3.396) | 23.229 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Barclays Bank | (12.885) |
| (2.234) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Barclays Bank | (3.396) | 1.944 | OneSpaWorld Holdings Ltd | Goldman Sachs | (26.349) |
| 13.278 | Omega Therapeutics Inc | Barclays Bank | (27.087) | (5.171) | OneWater Marine Inc 'A' | HSBC | (33.608) |
| | | | | | | Morgan Stanley | (286) |
| | | | | (17.281) | OneWater Marine Inc 'A' | Bank of America | |
| | | | | (7.233) | OneWater Marine Inc 'A' | Merrill Lynch | 3.051 |
| | | | | (4.617) | OneWater Marine Inc 'A' | Barclays Bank | 10.369 |
| | | | | (6.970) | OneWater Marine Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.267 |
| | | | | (11.705) | Onto Innovation Inc | HSBC | 2.170 |
| | | | | | | Morgan Stanley | 4.182 |
| | | | | (23.737) | Onto Innovation Inc | Bank of America | |
| | | | | (18.164) | Onto Innovation Inc | Merrill Lynch | (181.077) |
| | | | | | | Barclays Bank | (208.179) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (280.997) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (14.408) | Onto Innovation Inc | HSBC | (311.960) | 6.880 | Orgenesis Inc | Barclays Bank | 482 |
| (4.135) | Onto Innovation Inc | Morgan Stanley | (36.926) | 6.611 | Orgenesis Inc | Goldman Sachs | 1.058 |
| 12.770 | Ooma Inc | Bank of America | | 6.330 | Orgenesis Inc | Morgan Stanley | 443 |
| | | Merrill Lynch | (383) | (13.802) | ORIC Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 3.243 |
| 39.970 | Ooma Inc | Barclays Bank | (9.993) | (2.818) | ORIC Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 493 |
| 25.241 | Ooma Inc | Goldman Sachs | (757) | 26.019 | Origin Bancorp Inc | Barclays Bank | (25.759) |
| 7.473 | Ooma Inc | HSBC | 10.163 | 1.744 | Origin Bancorp Inc | Goldman Sachs | 3.941 |
| 8.785 | Ooma Inc | Morgan Stanley | (2.196) | (13.831) | Origin Materials Inc | Bank of America | |
| 20.456 | OP Bancorp | Goldman Sachs | 8.285 | | | Merrill Lynch | 4.426 |
| 18.276 | OP Bancorp | Morgan Stanley | (548) | (42.966) | Origin Materials Inc | Barclays Bank | 9.882 |
| (16.238) | Open Lending Corp 'A' | HSBC | (7.812) | (64.995) | Origin Materials Inc | Morgan Stanley | 14.949 |
| (21.017) | Open Lending Corp 'A' | Morgan Stanley | (2.942) | (11.043) | Orion Engineered | | |
| 8.827 | Opendoor Technologies Inc | Bank of America | | | Carbons SA | Barclays Bank | 16.046 |
| | | Merrill Lynch | 3.840 | (7.212) | Orion Engineered | | |
| 45.430 | Opendoor Technologies Inc | Barclays Bank | (1.136) | | Carbons SA | Morgan Stanley | 10.094 |
| 224.203 | Opendoor Technologies Inc | Morgan Stanley | (5.605) | (3.187) | Orion Office Inc (REIT) | Bank of America | |
| (13.889) | OPENLANE Inc | Goldman Sachs | 417 | | | Merrill Lynch | (414) |
| (13.899) | OPENLANE Inc | HSBC | 417 | (25.886) | Orion Office Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.365) |
| (51.980) | OPKO Health Inc | Barclays Bank | 6.238 | (4.985) | Ormat Technologies Inc | Bank of America | |
| 12.399 | Oportun Financial Corp | Barclays Bank | (496) | | | Merrill Lynch | (4.800) |
| 16.012 | Oportun Financial Corp | Goldman Sachs | 1.761 | (29.048) | Ormat Technologies Inc | Barclays Bank | (13.943) |
| 7.614 | Oportun Financial Corp | HSBC | 8.756 | (7.200) | Ormat Technologies Inc | Goldman Sachs | (8.287) |
| 1.289 | Oportun Financial Corp | Morgan Stanley | (52) | (13.590) | Ormat Technologies Inc | HSBC | (9.649) |
| (926) | Oppenheimer Holdings Inc 'A' | Bank of America | | (12.614) | Ormat Technologies Inc | Morgan Stanley | (6.055) |
| | | Merrill Lynch | (2.139) | 6.915 | Orrstown Financial | Bank of America | |
| (12.401) | Oppenheimer Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (19.966) | | Services Inc | Merrill Lynch | 13.346 |
| (2.576) | Oppenheimer Holdings Inc 'A' | | | 11.022 | Orrstown Financial | | |
| | | Morgan Stanley | (4.147) | | Services Inc | Barclays Bank | 2.425 |
| (5.641) | OptimizeRx Corp | Barclays Bank | (9.138) | 9.211 | Orrstown Financial | | |
| (9.450) | OptimizeRx Corp | Goldman Sachs | (6.615) | | Services Inc | Goldman Sachs | 17.777 |
| 49.657 | Optinose Inc | Barclays Bank | (4.966) | 11.169 | Orrstown Financial | | |
| 21.741 | Optinose Inc | HSBC | (14.566) | | Services Inc | HSBC | 19.434 |
| 1.245 | Option Care Health Inc | Bank of America | | 3.132 | Orrstown Financial | | |
| | | Merrill Lynch | (1.255) | | Services Inc | Morgan Stanley | 689 |
| 2.218 | Option Care Health Inc | Barclays Bank | (2.041) | 7.362 | Orthofix Medical Inc | Barclays Bank | (11.632) |
| 24.611 | Option Care Health Inc | Goldman Sachs | 8.614 | (9.390) | OrthoPediatrics Corp | Bank of America | |
| (1.831) | Option Care Health Inc | Goldman Sachs | (641) | | | Merrill Lynch | 18.498 |
| (7.873) | Option Care Health Inc | HSBC | 7.395 | (4.070) | OrthoPediatrics Corp | Barclays Bank | 11.009 |
| 725 | Option Care Health Inc | HSBC | (318) | (5.576) | OrthoPediatrics Corp | Goldman Sachs | 10.985 |
| (36.077) | Oracle Corp | Barclays Bank | (119.415) | (2.071) | OrthoPediatrics Corp | HSBC | 8.222 |
| (6.655) | Oracle Corp | Goldman Sachs | (52.042) | (5.162) | OrthoPediatrics Corp | Morgan Stanley | 13.963 |
| (6.174) | Oracle Corp | HSBC | (51.182) | 26.632 | Oscar Health Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.397 |
| (12.786) | Oracle Corp | Morgan Stanley | (42.322) | 17.138 | Oshkosh Corp | Bank of America | |
| 6.600 | OraSure Technologies Inc | Barclays Bank | (3.069) | | | Merrill Lynch | 9.899 |
| 14.476 | OraSure Technologies Inc | HSBC | (30.762) | 30.190 | Oshkosh Corp | Barclays Bank | (5.434) |
| (16.139) | Orchestra BioMed Holdings Inc | | | 12.209 | Oshkosh Corp | Goldman Sachs | 7.203 |
| | | Morgan Stanley | 24.370 | 34.713 | Oshkosh Corp | HSBC | (49.987) |
| (2.194) | Orchid Island Capital Inc (REIT) | Bank of America | | 13.200 | Oshkosh Corp | Morgan Stanley | (2.376) |
| | | Merrill Lynch | — | 5.169 | OSI Systems Inc | Barclays Bank | 6.565 |
| (19.875) | Orchid Island Capital Inc (REIT) | HSBC | (4.373) | 7.065 | Otis Worldwide Corp | Bank of America | |
| (39.297) | Orchid Island Capital Inc (REIT) | | | | | Merrill Lynch | (32.640) |
| 266 | O'Reilly Automotive Inc | Morgan Stanley | — | (2.109) | Otis Worldwide Corp | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 9.744 |
| 498 | O'Reilly Automotive Inc | Merrill Lynch | (14.606) | 31.703 | Otis Worldwide Corp | Goldman Sachs | (146.468) |
| 404 | O'Reilly Automotive Inc | Goldman Sachs | (22.746) | 6.004 | Otis Worldwide Corp | HSBC | (35.243) |
| 82 | O'Reilly Automotive Inc | HSBC | (21.278) | (7.944) | Otis Worldwide Corp | HSBC | 46.631 |
| (34.709) | Organogenesis Holdings Inc | Morgan Stanley | (3.097) | (5.032) | Otter Tail Corp | Bank of America | |
| | | Barclays Bank | (9.892) | | | Merrill Lynch | 9.016 |
| (11.383) | Organogenesis Holdings Inc | | | (7.277) | Otter Tail Corp | Barclays Bank | 7.495 |
| 4.894 | Organon & Co | Morgan Stanley | (3.244) | (6.683) | Otter Tail Corp | Goldman Sachs | 12.497 |
| | | Bank of America | | (4.717) | Otter Tail Corp | HSBC | 13.043 |
| 1.275 | Organon & Co | Merrill Lynch | (6.151) | (2.192) | Otter Tail Corp | Morgan Stanley | 2.258 |
| (17.003) | Organon & Co | Barclays Bank | (2.117) | (39.730) | Ouster Inc | Morgan Stanley | (27.414) |
| 6.911 | Organon & Co | Goldman Sachs | 29.925 | 36.502 | Outbrain Inc | Barclays Bank | 3.650 |
| 1.058 | Organon & Co | Goldman Sachs | (12.163) | 73.542 | Outfront Media Inc (REIT) | Barclays Bank | (22.063) |
| 10.610 | Organon & Co | HSBC | (2.899) | 12.057 | Outfront Media Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.809) |
| | | Morgan Stanley | (16.103) | 79.405 | Outfront Media Inc (REIT) | HSBC | (38.909) |
| | | | | (55.361) | Outlook Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (18.269) |
| | | | | (34.682) | Outlook Therapeutics Inc | HSBC | (13.526) |
| | | | | (11.688) | Outlook Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.169 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.178) | Outset Medical Inc | Bank of America | | (1.913) | Palantir Technologies Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.787) |
| | | Merrill Lynch | (1.303) | 2.325 | Palo Alto Networks Inc | Morgan Stanley | 52.963 |
| (8.714) | Outset Medical Inc | Barclays Bank | 13.245 | (734) | Palomar Holdings Inc | Bank of America | |
| (9.983) | Outset Medical Inc | HSBC | (5.690) | | | Merrill Lynch | (3.248) |
| (2.481) | Outset Medical Inc | Morgan Stanley | 3.771 | (2.564) | Palomar Holdings Inc | Barclays Bank | 3.884 |
| (51.342) | Overseas Shipholding Group Inc 'A' | Bank of America | | (352) | Palomar Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.558) |
| | | Merrill Lynch | 8.728 | (1.024) | PAM Transportation Services Inc | Barclays Bank | (932) |
| (25.219) | Overseas Shipholding Group Inc 'A' | Barclays Bank | 1.513 | (9.560) | PAM Transportation Services Inc | Morgan Stanley | (8.700) |
| 17.516 | Overstock.com Inc | Goldman Sachs | (21.019) | 10.265 | Pan American Silver Corp (Right) | Bank of America | |
| 13.073 | Overstock.com Inc | HSBC | (14.772) | | | Merrill Lynch | (103) |
| (11.490) | Ovid therapeutics Inc | Barclays Bank | (575) | 46.959 | Pan American Silver Corp (Right) | Goldman Sachs | (470) |
| (29.084) | Ovid therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.454) | 21.553 | Pan American Silver Corp (Right) | Morgan Stanley | (216) |
| 1.408 | Ovintiv Inc | Bank of America | | (21.999) | Pangaea Logistics Solutions Ltd | Barclays Bank | 6.490 |
| | | Merrill Lynch | (901) | (2.281) | Pangaea Logistics Solutions Ltd | Goldman Sachs | 821 |
| 14.400 | Ovintiv Inc | Barclays Bank | (34.560) | 3.575 | Papa John's International Inc | Bank of America | |
| 31.888 | Ovintiv Inc | Goldman Sachs | (20.409) | | | Merrill Lynch | (22.015) |
| 3.661 | Ovintiv Inc | HSBC | (7.944) | 3.966 | Papa John's International Inc | Barclays Bank | (16.974) |
| 10.083 | Ovintiv Inc | Morgan Stanley | (24.199) | 7.487 | Papa John's International Inc | Goldman Sachs | (47.543) |
| (5.758) | Owens & Minor Inc | Barclays Bank | 8.004 | 5.078 | Papa John's International Inc | HSBC | (39.151) |
| (10.687) | Owens & Minor Inc | Goldman Sachs | (5.557) | 5.839 | Papa John's International Inc | Morgan Stanley | (24.991) |
| (5.684) | Owens & Minor Inc | HSBC | (9.776) | (15.983) | Par Pacific Holdings Inc | Barclays Bank | 8.791 |
| (6.533) | Owens Corning | Barclays Bank | 13.523 | (3.745) | Par Pacific Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.445 |
| 6.207 | Owens Corning | Goldman Sachs | 2.048 | (10.622) | PAR Technology Corp | Bank of America | |
| (1.765) | Owens Corning | HSBC | (2.930) | | | Merrill Lynch | (14.625) |
| (4.394) | Owens Corning | Morgan Stanley | 9.096 | (1.988) | PAR Technology Corp | Barclays Bank | 3.062 |
| 210 | Oxford Industries Inc | Bank of America | | (6.744) | PAR Technology Corp | HSBC | (5.117) |
| | | Merrill Lynch | (159) | (4.118) | PAR Technology Corp | Morgan Stanley | 5.500 |
| 1.564 | Oxford Industries Inc | Barclays Bank | (6.256) | 11.848 | Paragon 28 Inc | Barclays Bank | 7.146 |
| 1.642 | Oxford Industries Inc | Goldman Sachs | (13.957) | 14.897 | Paragon 28 Inc | Morgan Stanley | 5.139 |
| 177 | Oxford Industries Inc | Morgan Stanley | (964) | 18.432 | Paramount Global 'A' | Bank of America | |
| (16.453) | PACCAR Inc | Barclays Bank | 23.363 | | | Merrill Lynch | 2.580 |
| (10.258) | PACCAR Inc | HSBC | 28.825 | 23.929 | Paramount Global 'A' | Barclays Bank | 22.254 |
| 3.590 | Pacific Biosciences of California Inc | Morgan Stanley | (3.087) | 22.521 | Paramount Global 'A' | Goldman Sachs | 3.153 |
| (1.269) | Pacific Premier Bancorp Inc | Bank of America | | 22.229 | Paramount Global 'A' | HSBC | (34.232) |
| | | Merrill Lynch | 791 | 7.977 | Paramount Global 'A' | Morgan Stanley | 7.418 |
| (17.161) | Pacific Premier Bancorp Inc | Barclays Bank | 13.097 | 5.897 | Paramount Global 'B' | Bank of America | |
| (27.461) | Pacific Premier Bancorp Inc | Goldman Sachs | (11.534) | | | Merrill Lynch | (1.451) |
| (4.262) | Pacific Premier Bancorp Inc | HSBC | 2.605 | 7.304 | Paramount Global 'B' | Barclays Bank | 7.351 |
| (857) | Pacific Premier Bancorp Inc | Morgan Stanley | 660 | 7.080 | Paramount Global 'B' | Goldman Sachs | 5.494 |
| 5.479 | Pacira BioSciences Inc | Bank of America | | 16.658 | Paramount Global 'B' | HSBC | (4.048) |
| | | Merrill Lynch | (18.629) | 92.818 | Paramount Group Inc (REIT) | Barclays Bank | (17.635) |
| 5.045 | Pacira BioSciences Inc | Barclays Bank | (12.058) | 79.817 | Paramount Group Inc (REIT) | HSBC | (12.771) |
| 4.183 | Pacira BioSciences Inc | HSBC | (10.583) | 54.418 | Paramount Group Inc (REIT) | Morgan Stanley | (10.340) |
| 6.144 | Pacira BioSciences Inc | Morgan Stanley | (14.684) | (29.496) | Paratek Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 11.208 |
| (8.269) | Packaging Corp of America | Bank of America | | (154) | Paratek Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 52 |
| | | Merrill Lynch | 49.283 | (22.328) | Park Aerospace Corp | Barclays Bank | (1.116) |
| (1.678) | Packaging Corp of America | Barclays Bank | 7.702 | (22.730) | Park Aerospace Corp | Goldman Sachs | (6.137) |
| (9.684) | Packaging Corp of America | Goldman Sachs | 57.717 | (18.746) | Park City Group Inc | Bank of America | |
| (308) | Packaging Corp of America | HSBC | 3.557 | | | Merrill Lynch | (28.494) |
| (9.356) | Packaging Corp of America | Morgan Stanley | 42.944 | (81.158) | Park City Group Inc | Barclays Bank | (47.883) |
| 19.488 | Pactiv Evergreen Inc | Bank of America | | 108.670 | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Barclays Bank | (30.428) |
| | | Merrill Lynch | (7.795) | 51.390 | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | HSBC | 2.570 |
| 31.714 | Pactiv Evergreen Inc | Barclays Bank | (17.760) | | | | |
| 16.810 | Pactiv Evergreen Inc | Goldman Sachs | (6.724) | | | | |
| 12.598 | Pactiv Evergreen Inc | HSBC | 378 | | | | |
| 36.635 | Pactiv Evergreen Inc | Morgan Stanley | (20.516) | | | | |
| 28.657 | PacWest Bancorp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 38.114 | | | | |
| 16.647 | PacWest Bancorp | Barclays Bank | (2.830) | | | | |
| 6.304 | PacWest Bancorp | HSBC | 4.476 | | | | |
| 14.488 | PagerDuty Inc | Barclays Bank | (28.396) | | | | |
| 1.685 | PagerDuty Inc | Goldman Sachs | (4.078) | | | | |
| 2.811 | PagerDuty Inc | HSBC | (6.072) | | | | |
| 10.649 | PagerDuty Inc | Morgan Stanley | (20.872) | | | | |
| (13.898) | Palantir Technologies Inc 'A' | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (66.293) | | | | |
| (35.506) | Palantir Technologies Inc 'A' | Goldman Sachs | (169.364) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (16.524) | Park National Corp | Morgan Stanley | 37.675 | 14.051 | PayPal Holdings Inc | Goldman Sachs | 7.869 |
| (12.192) | Parke Bancorp Inc | Bank of America | | 4.762 | PayPal Holdings Inc | HSBC | (60.525) |
| | | Merrill Lynch | (3.780) | 8.360 | PayPal Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.839) |
| (19.830) | Parke Bancorp Inc | Barclays Bank | 1.785 | 1.468 | Paysafe Ltd | Bank of America | |
| (10.374) | Parke Bancorp Inc | Goldman Sachs | (3.216) | | | Merrill Lynch | (2.256) |
| (904) | Parke Bancorp Inc | HSBC | (334) | 27.079 | Paysafe Ltd | Barclays Bank | (57.137) |
| (9.235) | Parke Bancorp Inc | Morgan Stanley | 831 | 15.966 | Paysafe Ltd | Goldman Sachs | (79.351) |
| 1.107 | Parker Drilling Co | HSBC | 277 | 14.778 | Paysafe Ltd | HSBC | (72.560) |
| 69 | Parker-Hannifin Corp | Bank of America | | 8.368 | Paysafe Ltd | Morgan Stanley | (14.694) |
| | | Merrill Lynch | (121) | (41.190) | Paysign Inc | Bank of America | |
| 3.684 | Parker-Hannifin Corp | Barclays Bank | (30.172) | | | Merrill Lynch | 26.362 |
| (2.565) | Parker-Hannifin Corp | Barclays Bank | 21.007 | (17.193) | Paysign Inc | Barclays Bank | 11.863 |
| 199 | Parker-Hannifin Corp | HSBC | (236) | (4.817) | Paysign Inc | Goldman Sachs | 3.083 |
| (311) | Parker-Hannifin Corp | HSBC | 2.765 | (11.281) | Paysign Inc | HSBC | 8.912 |
| 73 | Parker-Hannifin Corp | Morgan Stanley | (598) | (15.724) | Paysign Inc | Morgan Stanley | 10.850 |
| (1.965) | Park-Ohio Holdings Corp | Bank of America | | (7.419) | PBF Energy Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.631 | | | Merrill Lynch | (6.406) |
| (7.585) | Park-Ohio Holdings Corp | Barclays Bank | 1.441 | (987) | PBF Energy Inc 'A' | Barclays Bank | 2.115 |
| (1.848) | Park-Ohio Holdings Corp | Goldman Sachs | 1.534 | 3.485 | PBF Energy Inc 'A' | Barclays Bank | (5.018) |
| (2.859) | Park-Ohio Holdings Corp | HSBC | 915 | 3.233 | PBF Energy Inc 'A' | HSBC | 14.258 |
| (1.050) | Park-Ohio Holdings Corp | Morgan Stanley | 200 | (3.689) | PBF Energy Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.312 |
| 37.191 | Parsons Corp | Barclays Bank | (7.066) | 10.434 | PC Connection Inc | Barclays Bank | 4.904 |
| 2.601 | Parsons Corp | Goldman Sachs | (1.144) | 1.203 | PC Connection Inc | Goldman Sachs | 4.223 |
| 9.061 | Parsons Corp | HSBC | 1.269 | 4.773 | PC Connection Inc | HSBC | 29.948 |
| 13.153 | Passage Bio Inc | Barclays Bank | (658) | 16.582 | PC Connection Inc | Morgan Stanley | 7.794 |
| 26.679 | Passage Bio Inc | Goldman Sachs | (1.334) | (5.870) | PCB Bancorp | Bank of America | |
| 4.716 | Passage Bio Inc | HSBC | (141) | | | Merrill Lynch | (2.994) |
| 7.899 | Passage Bio Inc | Morgan Stanley | (395) | (27.805) | PCB Bancorp | Barclays Bank | 556 |
| (4.403) | Pathward Financial Inc | Bank of America | | (23.327) | PCB Bancorp | Goldman Sachs | (11.897) |
| | | Merrill Lynch | (3.346) | (9.614) | PCB Bancorp | HSBC | (4.519) |
| (7.395) | Pathward Financial Inc | Goldman Sachs | (5.620) | (5.270) | PCB Bancorp | Morgan Stanley | 105 |
| (6.286) | Pathward Financial Inc | HSBC | (11.818) | (12.121) | PCTEL Inc | Bank of America | |
| (292) | Pathward Financial Inc | Morgan Stanley | 286 | | | Merrill Lynch | 727 |
| 1.666 | Patrick Industries Inc | Barclays Bank | (5.481) | (16.023) | PCTEL Inc | Barclays Bank | (1.442) |
| 3.166 | Patrick Industries Inc | Goldman Sachs | (981) | (39.394) | PCTEL Inc | Goldman Sachs | 2.364 |
| 1.351 | Patrick Industries Inc | HSBC | (378) | (12.130) | PCTEL Inc | Morgan Stanley | (1.092) |
| 1.971 | Patrick Industries Inc | Morgan Stanley | (6.485) | 4.222 | PDC Energy Inc | Bank of America | |
| (630) | Patterson Cos Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 24.108 |
| | | Merrill Lynch | 165 | 10.306 | PDC Energy Inc | Barclays Bank | (4.637) |
| (8.740) | Patterson Cos Inc | Goldman Sachs | 10.838 | 5.035 | PDC Energy Inc | Goldman Sachs | 28.750 |
| (1.916) | Patterson Cos Inc | HSBC | 2.073 | 7.459 | PDC Energy Inc | HSBC | 36.101 |
| 15.378 | Patterson-UTI Energy Inc | Bank of America | | 9.848 | PDC Energy Inc | Morgan Stanley | (4.432) |
| | | Merrill Lynch | (4.152) | (1.287) | PDF Solutions Inc | Goldman Sachs | (8.610) |
| 66.703 | Patterson-UTI Energy Inc | Barclays Bank | (60.700) | (337.585) | PDL BioPharma Inc* | Bank of America | |
| 58.068 | Patterson-UTI Energy Inc | Goldman Sachs | (15.678) | | | Merrill Lynch | 833.832 |
| 24.342 | Patterson-UTI Energy Inc | HSBC | (15.335) | (46.279) | PDL BioPharma Inc* | Barclays Bank | 114.309 |
| 48.009 | Patterson-UTI Energy Inc | Morgan Stanley | (43.688) | (74.293) | PDL BioPharma Inc* | Goldman Sachs | 183.503 |
| (104.174) | PAVmed Inc | Barclays Bank | — | (98.282) | PDL BioPharma Inc* | HSBC | 242.756 |
| 1.398 | Paychex Inc | Bank of America | | (141.740) | PDL BioPharma Inc* | Morgan Stanley | 89.658 |
| | | Merrill Lynch | (3.173) | (19.125) | PDS Biotechnology Corp | Barclays Bank | (8.798) |
| 6.261 | Paychex Inc | Barclays Bank | (25.608) | (5.170) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Bank of America | |
| 18.885 | Paychex Inc | Goldman Sachs | (42.869) | | | Merrill Lynch | (8.634) |
| 2.255 | Paychex Inc | HSBC | (1.812) | (6.749) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Barclays Bank | 9.179 |
| 1.685 | Paychex Inc | Morgan Stanley | (6.892) | | | | |
| 4.820 | Paycom Software Inc | Barclays Bank | (44.970) | (12.091) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Goldman Sachs | (20.192) |
| 1.115 | Paycom Software Inc | Goldman Sachs | 9.087 | (9.152) | Peapack-Gladstone Financial Corp | HSBC | (18.487) |
| 1.315 | Paycom Software Inc | HSBC | 7.219 | | | | |
| 773 | Paycom Software Inc | Morgan Stanley | (7.212) | (10.587) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Morgan Stanley | 14.398 |
| (7.664) | Paycor HCM Inc | Barclays Bank | 4.368 | (739) | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Bank of America | |
| (5.656) | Paycor HCM Inc | HSBC | 5.826 | | | Merrill Lynch | 285 |
| (9.221) | Paycor HCM Inc | Morgan Stanley | 5.256 | (19.743) | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Goldman Sachs | 7.601 |
| 2.116 | Paylocity Holding Corp | Barclays Bank | (3.808) | (39.727) | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | HSBC | 38.337 |
| 556 | Paylocity Holding Corp | Goldman Sachs | 1.573 | | | | |
| 1.447 | Paylocity Holding Corp | HSBC | (1.867) | (12.086) | Pediatric Medical Group Inc | Barclays Bank | 5.922 |
| 3.628 | Paylocity Holding Corp | Morgan Stanley | (6.530) | (6.589) | Pegasystems Inc | Goldman Sachs | (30.639) |
| (21.241) | Paymentus Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 13.382 | (3.662) | Pegasystems Inc | HSBC | (14.502) |
| (6.421) | Payoneer Global Inc | HSBC | 3.647 | | | | |
| (51.847) | Payoneer Global Inc | Morgan Stanley | 23.072 | | | | |
| 13.075 | PayPal Holdings Inc | Barclays Bank | (2.877) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|----------------------------------|---|---|-----------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.579) | Pegasystems Inc | Morgan Stanley | (3.920) | 19.584 | Perella Weinberg Partners | Barclays Bank | (6.267) |
| (8.141) | Peloton Interactive Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 3.460 | 416 | Perficient Inc | Barclays Bank | (524) |
| (7.857) | Peloton Interactive Inc 'A' | HSBC | 8.446 | 3.222 | Perficient Inc | HSBC | 15.627 |
| (31.598) | Peloton Interactive Inc 'A' | Morgan Stanley | 9.954 | (2.595) | Performance Food Group Co | Bank of America Merrill Lynch | 10.925 |
| 17.438 | Penn Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.628 | (33.952) | Performance Food Group Co | Barclays Bank | 70.280 |
| 47.438 | Penn Entertainment Inc | Barclays Bank | (7.116) | 8.287 | Performance Food Group Co | Goldman Sachs | (34.888) |
| 16.932 | Penn Entertainment Inc | HSBC | (13.207) | (2.253) | Performance Food Group Co | Goldman Sachs | 9.485 |
| 17.498 | Penn Entertainment Inc | Morgan Stanley | (2.625) | (4.385) | Performance Food Group Co | HSBC | 25.477 |
| (4.447) | Pennant Group Inc | Barclays Bank | 4.002 | (10.118) | Performance Food Group Co | Morgan Stanley | 20.944 |
| (100) | Pennant Group Inc | HSBC | 7 | (32.574) | Perimeter Solutions SA | Barclays Bank | 18.241 |
| (7.475) | Pennant Group Inc | Morgan Stanley | 6.728 | (37.598) | Perimeter Solutions SA | HSBC | 64.497 |
| 7.023 | Penns Woods Bancorp Inc | Barclays Bank | 3.652 | (51.236) | Perimeter Solutions SA | Morgan Stanley | 28.692 |
| 1.404 | Penns Woods Bancorp Inc | Morgan Stanley | 730 | (82.424) | Permian Resources Corp | Barclays Bank | 69.236 |
| (15.267) | PennyMac Financial Services Inc | Barclays Bank | 14.350 | (35.581) | Permian Resources Corp | Goldman Sachs | 6.049 |
| (23.463) | PennyMac Financial Services Inc | Goldman Sachs | (4.693) | (83.860) | Permian Resources Corp | HSBC | 92.811 |
| (414) | PennyMac Financial Services Inc | Morgan Stanley | 389 | (8.272) | Permian Resources Corp | Morgan Stanley | 6.948 |
| (36.278) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | Barclays Bank | 2.902 | (5.501) | Perrigo Co Plc | Morgan Stanley | 10.507 |
| (22.005) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | Goldman Sachs | (1.100) | 41.317 | Personalis Inc | Barclays Bank | (11.569) |
| 16.029 | Penske Automotive Group Inc | Barclays Bank | (19.555) | 61.803 | Personalis Inc | Goldman Sachs | (23.485) |
| (840) | Penske Automotive Group Inc | Barclays Bank | 1.161 | 42.502 | Personalis Inc | HSBC | (19.126) |
| 35 | Penske Automotive Group Inc | Goldman Sachs | (10) | 63.676 | Petco Health & Wellness Co Inc | Barclays Bank | (134.356) |
| (364) | Penske Automotive Group Inc | Goldman Sachs | (120) | 44.614 | Petco Health & Wellness Co Inc | Morgan Stanley | (94.136) |
| 4.612 | Penske Automotive Group Inc | HSBC | 784 | 9.305 | PetIQ Inc | Barclays Bank | (8.933) |
| (2.121) | Penske Automotive Group Inc | Morgan Stanley | 5.183 | 5.938 | PetIQ Inc | Goldman Sachs | (891) |
| (19.830) | Pentair Plc | Barclays Bank | 60.680 | 16.070 | PetIQ Inc | Morgan Stanley | (15.427) |
| (380) | Pentair Plc | Goldman Sachs | 864 | (5.068) | PetMed Express Inc | Bank of America Merrill Lynch | 970 |
| (7.776) | Pentair Plc | HSBC | 18.973 | (56.999) | PetMed Express Inc | Barclays Bank | 29.639 |
| (3.206) | Pentair Plc | Morgan Stanley | 9.810 | (16.940) | Pfizer Inc | Barclays Bank | 26.426 |
| 587 | Penumbra Inc | Barclays Bank | (5.078) | (1.048) | Pfizer Inc | Goldman Sachs | (31) |
| 837 | Penumbra Inc | HSBC | (578) | (1.524) | Pfizer Inc | Morgan Stanley | 2.377 |
| 1.281 | Penumbra Inc | Morgan Stanley | (11.081) | (3.107) | PFSweb Inc | Bank of America Merrill Lynch | (808) |
| (6.269) | Peoples Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (13.549) | (7.885) | PFSweb Inc | Goldman Sachs | (2.050) |
| (3.830) | Peoples Bancorp Inc | Barclays Bank | 38 | (22.863) | PG&E Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6.859 |
| (1.603) | Peoples Bancorp Inc | Goldman Sachs | (4.056) | (11.113) | PG&E Corp | Barclays Bank | (2.890) |
| (5.911) | Peoples Bancorp Inc | HSBC | (10.008) | (172.786) | PG&E Corp | Goldman Sachs | 51.836 |
| (7.921) | Peoples Bancorp Inc | Morgan Stanley | 79 | (2.400) | PG&E Corp | HSBC | 1.536 |
| (456) | Peoples Financial Services Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.473) | (75.413) | PG&E Corp | Morgan Stanley | (19.607) |
| (5.551) | Peoples Financial Services Corp | Barclays Bank | (5.551) | 6.237 | PGT Innovations Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.748) |
| (2.652) | Peoples Financial Services Corp | Goldman Sachs | (8.566) | 3.041 | PGT Innovations Inc | Barclays Bank | (428) |
| (1.812) | Peoples Financial Services Corp | Morgan Stanley | (1.812) | 2.377 | PGT Innovations Inc | Goldman Sachs | (1.165) |
| 3.487 | PepsiCo Inc | Bank of America Merrill Lynch | (42.088) | 2.406 | PGT Innovations Inc | HSBC | (651) |
| 4.596 | PepsiCo Inc | Barclays Bank | (20.295) | (8.533) | Phathom Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 15.103 |
| 37.078 | PepsiCo Inc | Goldman Sachs | (447.531) | (9.692) | Phathom Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 17.155 |
| 29.251 | PepsiCo Inc | HSBC | (324.144) | 7.716 | PhenomeX Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.080) |
| 31.281 | PepsiCo Inc | Morgan Stanley | (138.888) | 8.795 | PhenomeX Inc | Barclays Bank | (1.318) |
| (1.516) | Perdoceo Education Corp | Bank of America Merrill Lynch | 61 | 5.157 | PhenomeX Inc | Goldman Sachs | (722) |
| (22.889) | Perdoceo Education Corp | Barclays Bank | 10.071 | 34.322 | PhenomeX Inc | HSBC | (7.156) |
| (10.317) | Perdoceo Education Corp | HSBC | 2.682 | 12.659 | PhenomeX Inc | Morgan Stanley | (1.898) |
| | | | | (2.315) | Phibro Animal Health Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.709 |
| | | | | (11.138) | Phibro Animal Health Corp 'A' | Barclays Bank | 9.913 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (13.305) | Phibro Animal Health Corp 'A' | Goldman Sachs | 15.567 | (4.087) | Pilgrim's Pride Corp | Goldman Sachs | 2.370 |
| (4.002) | Phibro Animal Health Corp 'A' | HSBC | 4.482 | (17.135) | Pilgrim's Pride Corp | HSBC | 7.368 |
| (6.180) | Philip Morris International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 29.726 | (5.022) | Pilgrim's Pride Corp | Morgan Stanley | 5.876 |
| (7.182) | Philip Morris International Inc | Barclays Bank | 20.684 | 2.444 | Pinnacle Financial Partners Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.046) |
| (25.800) | Philip Morris International Inc | HSBC | 138.546 | 34.745 | Pinnacle Financial Partners Inc | Barclays Bank | (46.211) |
| (8.569) | Philip Morris International Inc | Morgan Stanley | 24.679 | 39.296 | Pinnacle Financial Partners Inc | Goldman Sachs | 15.439 |
| 4.900 | Phillips 66 | Bank of America Merrill Lynch | (11.466) | 8.986 | Pinnacle Financial Partners Inc | HSBC | 7.195 |
| 4.766 | Phillips 66 | Barclays Bank | (17.539) | 11.800 | Pinnacle Financial Partners Inc | Morgan Stanley | (15.327) |
| 6.832 | Phillips 66 | Goldman Sachs | (15.987) | (2.805) | Pinnacle West Capital Corp | Barclays Bank | (297) |
| 5.208 | Phillips 66 | HSBC | (8.827) | (6.036) | Pinnacle West Capital Corp | Goldman Sachs | 20.341 |
| (1.494) | Phillips 66 | HSBC | 4.869 | (5.945) | Pinnacle West Capital Corp | HSBC | 1.007 |
| 1.268 | Phillips 66 | Morgan Stanley | (4.666) | 5.612 | Pinnacle West Capital Corp | Morgan Stanley | (5.107) |
| (526) | Phillips 66 | Morgan Stanley | 2.461 | (1.770) | Pinnacle West Capital Corp | Morgan Stanley | 1.611 |
| 3.206 | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.337) | 3.771 | Pinterest Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 7.033 |
| (14.409) | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Barclays Bank | 14.409 | 3.546 | Pinterest Inc 'A' | Barclays Bank | 2.323 |
| 15.835 | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Barclays Bank | (15.835) | 12.920 | Pinterest Inc 'A' | Goldman Sachs | 24.096 |
| (8.453) | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Goldman Sachs | 9.129 | 19.202 | Pinterest Inc 'A' | HSBC | 44.645 |
| 40.692 | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | HSBC | (63.348) | 8.407 | Pinterest Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.507 |
| (14.085) | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | HSBC | 45.213 | (3.103) | Pioneer Bancorp Inc | Goldman Sachs | (698) |
| 10.665 | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Morgan Stanley | (7.889) | (86.620) | Pioneer Bancorp Inc | Morgan Stanley | 9.961 |
| 19.498 | Photronics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 89.886 | 486 | Pioneer Natural Resources Co | Bank of America Merrill Lynch | (3.985) |
| 8.339 | Photronics Inc | Barclays Bank | 31.355 | 2.383 | Pioneer Natural Resources Co | Barclays Bank | (22.853) |
| 22.571 | Photronics Inc | HSBC | 136.329 | 3.696 | Pioneer Natural Resources Co | Goldman Sachs | (19.700) |
| 2.195 | Phreesia Inc | HSBC | 176 | 459 | Pioneer Natural Resources Co | HSBC | (5.771) |
| (31.171) | PHX Minerals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.870 | 251 | Pioneer Natural Resources Co | Morgan Stanley | (2.407) |
| (17.887) | PHX Minerals Inc | Barclays Bank | 3.041 | (144) | Piper Sandler Cos | Bank of America Merrill Lynch | (481) |
| (11.531) | PHX Minerals Inc | Goldman Sachs | 692 | (4.802) | Piper Sandler Cos | Barclays Bank | 3.361 |
| (2.276) | PHX Minerals Inc | HSBC | (455) | (2.454) | Piper Sandler Cos | Goldman Sachs | (8.196) |
| (20.472) | Physicians Realty Trust (REIT) | Barclays Bank | 4.913 | (1.214) | Piper Sandler Cos | HSBC | (3.193) |
| 28.498 | Physicians Realty Trust (REIT) | Barclays Bank | (6.840) | (137.693) | Pitney Bowes Inc | Barclays Bank | (11.727) |
| (71.251) | Physicians Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 54.151 | (48.121) | Pitney Bowes Inc | Goldman Sachs | (12.511) |
| (16.113) | Physicians Realty Trust (REIT) | HSBC | 14.018 | (106.113) | Pitney Bowes Inc | HSBC | (32.895) |
| (3.771) | Piedmont Lithium Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.863 | (8.555) | Pitney Bowes Inc | Morgan Stanley | (76) |
| (5.927) | Piedmont Lithium Inc | Barclays Bank | 17.840 | (40.175) | Pixelworks Inc | Barclays Bank | 804 |
| 28.567 | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (4.856) | (15.935) | Pixelworks Inc | Goldman Sachs | (3.665) |
| 131.239 | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | (60.370) | (9.939) | Pixelworks Inc | Morgan Stanley | 199 |
| 26.672 | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | HSBC | (8.268) | 2.718 | PJT Partners Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 9.866 |
| 77.991 | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | (35.876) | 4.279 | PJT Partners Inc 'A' | Barclays Bank | 4.835 |
| 33.189 | Pieris Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (3.256) | 3.791 | PJT Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 13.761 |
| 28.423 | Pieris Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (2.351) | 2.309 | PJT Partners Inc 'A' | HSBC | 12.579 |
| 16.172 | Pieris Pharmaceuticals Inc | HSBC | (953) | 6.975 | PJT Partners Inc 'A' | Morgan Stanley | 7.882 |
| (3.666) | Pilgrim's Pride Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.126 | 294 | Planet Fitness Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.394) |
| (8.693) | Pilgrim's Pride Corp | Barclays Bank | 10.171 | 10.543 | Planet Fitness Inc 'A' | Barclays Bank | (39.431) |
| | | | | 4.353 | Planet Fitness Inc 'A' | Goldman Sachs | (20.633) |
| | | | | 2.936 | Planet Fitness Inc 'A' | Morgan Stanley | (10.980) |
| | | | | (59.641) | Planet Labs PBC | Bank of America Merrill Lynch | (17.296) |
| | | | | (24.377) | Planet Labs PBC | Goldman Sachs | (7.069) |
| | | | | (32.513) | Planet Labs PBC | HSBC | (16.257) |
| | | | | (132.710) | Planet Labs PBC | Morgan Stanley | (13.271) |
| | | | | 3.152 | PlayAGS Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.860) |
| | | | | 23.452 | PlayAGS Inc | Barclays Bank | (16.416) |
| | | | | 18.415 | PlayAGS Inc | Goldman Sachs | (10.865) |
| | | | | 22.566 | PlayAGS Inc | HSBC | 4.062 |
| | | | | 6.710 | PlayAGS Inc | Morgan Stanley | (4.697) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (8.821) | Playstudios Inc | HSBC | 706 | 137 | Portage Biotech Inc | Bank of America | |
| (13.978) | Playstudios Inc | Morgan Stanley | 3.495 | | | Merrill Lynch | 45 |
| 24.458 | Playtika Holding Corp | Bank of America | | 5.655 | Portage Biotech Inc | Barclays Bank | 3.845 |
| | | Merrill Lynch | (14.919) | 1.216 | Portage Biotech Inc | Goldman Sachs | 401 |
| 27.556 | Playtika Holding Corp | Barclays Bank | (9.645) | 956 | Portage Biotech Inc | HSBC | 315 |
| 20.411 | Playtika Holding Corp | Goldman Sachs | (12.451) | 2.671 | Portage Biotech Inc | Morgan Stanley | 1.816 |
| 7.975 | Playtika Holding Corp | HSBC | (2.631) | 8.286 | Portillo's Inc 'A' | HSBC | (2.817) |
| 19.264 | Playtika Holding Corp | Morgan Stanley | (6.742) | 20.604 | Portland General Electric Co | Bank of America | |
| (86.551) | PLBY Group Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (43.267) |
| | | Merrill Lynch | 16.012 | 68.283 | Portland General Electric Co | Barclays Bank | (68.610) |
| (1.892) | Plexus Corp | Barclays Bank | (6.944) | 45.094 | Portland General Electric Co | Goldman Sachs | (97.534) |
| (2.532) | Plexus Corp | Morgan Stanley | (9.292) | 34.115 | Portland General Electric Co | HSBC | (85.827) |
| (6.430) | Plug Power Inc | Bank of America | | 73.062 | Portland General Electric Co | Morgan Stanley | (72.351) |
| | | Merrill Lynch | 1.562 | 17.404 | Poseida Therapeutics Inc | Barclays Bank | (7.484) |
| (4.479) | Plug Power Inc | Barclays Bank | 1.120 | 29.009 | Poseida Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (16.245) |
| (12.959) | Plug Power Inc | Goldman Sachs | (9.460) | 5.288 | Poseida Therapeutics Inc | HSBC | (5.235) |
| (34.536) | Plug Power Inc | Morgan Stanley | 2.773 | 7.392 | Poseida Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (3.179) |
| (3.735) | Plumas Bancorp | Bank of America | | 930 | Post Holdings Inc | Bank of America | |
| (530) | Plumas Bancorp | Barclays Bank | (27) | | | Merrill Lynch | (1.147) |
| (1.764) | Plumas Bancorp | Morgan Stanley | (88) | (23.355) | Post Holdings Inc | Barclays Bank | 36.667 |
| (9.730) | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Bank of America | | 268 | Post Holdings Inc | Barclays Bank | 203 |
| | | Merrill Lynch | (9.730) | 1.191 | Post Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.871) |
| (4.939) | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Barclays Bank | (642) | (2.244) | Post Holdings Inc | HSBC | 11.601 |
| (5.850) | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Goldman Sachs | (5.850) | (7.990) | Potbelly Corp | Bank of America | |
| (4.793) | Plymouth Industrial Inc (REIT) | HSBC | (3.499) | | | Merrill Lynch | 6.392 |
| (4.646) | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Morgan Stanley | (604) | (32.455) | PotlatchDeltic Corp (REIT) | Barclays Bank | 1.623 |
| 54.350 | PMV Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (22.576) | PotlatchDeltic Corp (REIT) | Goldman Sachs | 16.029 |
| | | Merrill Lynch | (22.284) | (5.638) | PotlatchDeltic Corp (REIT) | HSBC | (1.015) |
| 21.448 | PMV Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (7.721) | 2.908 | Powell Industries Inc | Barclays Bank | 1.977 |
| 33.472 | PMV Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (13.724) | 2.514 | Powell Industries Inc | Goldman Sachs | 3.268 |
| 39.768 | PMV Pharmaceuticals Inc | HSBC | 15.112 | 1.613 | Powell Industries Inc | HSBC | 11.549 |
| 17.192 | PMV Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (6.189) | 444 | Powell Industries Inc | Morgan Stanley | 302 |
| (15.232) | PNM Resources Inc | Barclays Bank | 2.285 | 2.993 | Power Integrations Inc | Bank of America | |
| 8.334 | PNM Resources Inc | HSBC | (24.085) | | | Merrill Lynch | 23.106 |
| (18.418) | PNM Resources Inc | Morgan Stanley | 2.763 | 13.212 | Power Integrations Inc | Barclays Bank | 11.891 |
| (17.411) | Point Biopharma Global Inc | Bank of America | | (823) | Power Integrations Inc | Barclays Bank | (741) |
| | | Merrill Lynch | 23.679 | 9.337 | Power Integrations Inc | Goldman Sachs | 72.082 |
| (2.409) | Point Biopharma Global Inc | Barclays Bank | 2.554 | 11.317 | Power Integrations Inc | HSBC | 94.837 |
| (6.434) | Point Biopharma Global Inc | Morgan Stanley | 6.820 | 8.375 | Power Integrations Inc | Morgan Stanley | 7.538 |
| (3.664) | Polaris Inc | Bank of America | | (1.580) | Power Integrations Inc | Morgan Stanley | (1.422) |
| | | Merrill Lynch | (11.323) | (10.778) | Powerfleet Inc | Bank of America | |
| (5.272) | Polaris Inc | Barclays Bank | (5.580) | | | Merrill Lynch | (2.156) |
| (1.343) | Polaris Inc | Goldman Sachs | (3.693) | (37.316) | Powerfleet Inc | Barclays Bank | (373) |
| (5.060) | Polaris Inc | Morgan Stanley | (6.297) | (17.161) | Powerfleet Inc | Goldman Sachs | (3.432) |
| 52.689 | PolyMet Mining Corp | Bank of America | | (11.752) | Powerfleet Inc | HSBC | (3.643) |
| | | Merrill Lynch | (8.430) | (9.519) | Powerfleet Inc | Morgan Stanley | (95) |
| 68.105 | PolyMet Mining Corp | Barclays Bank | (10.897) | 1.730 | PowerSchool Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (519) |
| 66.374 | PolyMet Mining Corp | Goldman Sachs | (10.620) | | | | |
| 43.141 | PolyMet Mining Corp | HSBC | (9.922) | 8.034 | PowerSchool Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.410) |
| 17.550 | PolyMet Mining Corp | Morgan Stanley | (2.808) | 1.895 | PPG Industries Inc | Barclays Bank | (3.421) |
| (19.865) | Ponce Financial Group Inc | Bank of America | | 3.502 | PPG Industries Inc | HSBC | (7.961) |
| | | Merrill Lynch | (18.176) | 41.137 | PPL Corp | Bank of America | |
| (5.796) | Ponce Financial Group Inc | Barclays Bank | 782 | | | Merrill Lynch | (85.497) |
| (14.357) | Ponce Financial Group Inc | HSBC | (8.255) | 317.096 | PPL Corp | Barclays Bank | (316.455) |
| (15.094) | Ponce Financial Group Inc | Morgan Stanley | 2.038 | 128.127 | PPL Corp | Goldman Sachs | (276.754) |
| (2.801) | Pool Corp | Bank of America | | 87.587 | PPL Corp | HSBC | (228.602) |
| | | Merrill Lynch | 56.440 | 50.627 | PPL Corp | Morgan Stanley | (49.964) |
| (2.084) | Pool Corp | Barclays Bank | 43.118 | (7.142) | PRA Group Inc | Barclays Bank | 2.428 |
| (1.228) | Pool Corp | HSBC | 38.277 | (8.582) | PRA Group Inc | Goldman Sachs | 3.604 |
| (1.311) | Pool Corp | Morgan Stanley | 27.125 | (7.323) | PRA Group Inc | HSBC | 115.923 |
| (14.390) | Popular Inc | Bank of America | | (15.209) | PRA Group Inc | Morgan Stanley | 5.171 |
| | | Merrill Lynch | (32.521) | (5.649) | Praxis Precision Medicines Inc | Barclays Bank | 904 |
| (12.803) | Popular Inc | Barclays Bank | 11.010 | | | | |
| (20.306) | Popular Inc | HSBC | (30.662) | (32.596) | Praxis Precision Medicines Inc | HSBC | 5.541 |
| (26.282) | Popular Inc | Morgan Stanley | 22.603 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 43.760 | Precigen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (875) | (15.293) | ProAssurance Corp | Bank of America Merrill Lynch | 33.339 |
| 21.900 | Precigen Inc | Barclays Bank | (2.628) | (8.032) | ProAssurance Corp | Barclays Bank | 1.365 |
| 47.870 | Precigen Inc | Morgan Stanley | (5.744) | (32.023) | ProAssurance Corp | Goldman Sachs | 69.810 |
| 11.157 | Precision BioSciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.032 | (5.669) | ProAssurance Corp | HSBC | 35.034 |
| 47.200 | Precision BioSciences Inc | Barclays Bank | 3.134 | (11.358) | ProAssurance Corp | Morgan Stanley | 1.931 |
| 37.068 | Precision BioSciences Inc | Goldman Sachs | 3.429 | (1.345) | PROCEPT BioRobotics Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.305 |
| 7.848 | Precision BioSciences Inc | HSBC | — | (7.828) | PROCEPT BioRobotics Corp | Morgan Stanley | 14.482 |
| 9.354 | Precision BioSciences Inc | Morgan Stanley | 621 | (685) | Procore Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.425) |
| 965 | Preformed Line Products Co | Morgan Stanley | (6.427) | (7.104) | Procore Technologies Inc | Barclays Bank | (8.099) |
| 4.572 | Prelude Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.709) | (4.150) | Procore Technologies Inc | Goldman Sachs | (14.691) |
| 4.060 | Prelude Therapeutics Inc | Barclays Bank | 568 | (5.109) | Procore Technologies Inc | HSBC | (19.616) |
| 5.062 | Prelude Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (5.214) | (3.452) | Procore Technologies Inc | Morgan Stanley | (3.935) |
| 9.408 | Prelude Therapeutics Inc | HSBC | (7.150) | 30.875 | Procter & Gamble Co | Barclays Bank | (219.521) |
| 21.425 | Premier Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.285 | 757 | Procter & Gamble Co | Goldman Sachs | (10.568) |
| 18.050 | Premier Financial Corp | Barclays Bank | (10.504) | 3.837 | Procter & Gamble Co | HSBC | (50.840) |
| 27.531 | Premier Financial Corp | Goldman Sachs | 5.506 | 3.672 | Procter & Gamble Co | Morgan Stanley | (26.108) |
| 9.169 | Premier Financial Corp | HSBC | (1.284) | (15.366) | ProFrac Holding Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (12.985) |
| (42.051) | Premier Inc 'A' | Barclays Bank | 67.702 | (22.915) | ProFrac Holding Corp 'A' | HSBC | (32.539) |
| (10.369) | Premier Inc 'A' | HSBC | 15.035 | (26.393) | ProFrac Holding Corp 'A' | Morgan Stanley | 10.821 |
| (7.666) | Premier Inc 'A' | Morgan Stanley | 12.342 | 2.959 | PROG Holdings Inc | Barclays Bank | 2.101 |
| 18.334 | Prestige Consumer Healthcare Inc | Goldman Sachs | (13.751) | 4.474 | PROG Holdings Inc | HSBC | 10.843 |
| 12.683 | Prestige Consumer Healthcare Inc | HSBC | (20.420) | 3.794 | PROG Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.694 |
| 3.479 | PriceSmart Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.689 | (26.262) | Progress Software Corp | HSBC | (154.421) |
| 7.014 | PriceSmart Inc | HSBC | 13.046 | (7.342) | Progress Software Corp | Morgan Stanley | (10.059) |
| 4.080 | PriceSmart Inc | Morgan Stanley | (2.530) | 1.133 | Progressive Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.725) |
| (23.365) | Primerica Inc | Barclays Bank | 56.543 | 2.338 | Progressive Corp | Barclays Bank | (18.236) |
| (2.130) | Primerica Inc | Goldman Sachs | (2.939) | 1.779 | Progressive Corp | Goldman Sachs | (7.418) |
| (1.137) | Primerica Inc | Morgan Stanley | 2.752 | 1.076 | Progressive Corp | HSBC | (6.736) |
| (43.065) | Primis Financial Corp | Barclays Bank | 1.723 | 1.304 | Progressive Corp | Morgan Stanley | (10.171) |
| (38.842) | Primis Financial Corp | Goldman Sachs | (11.264) | (562) | Progyny Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.068) |
| 89.455 | Primo Water Corp | Barclays Bank | (78.720) | 4.244 | Progyny Inc | Barclays Bank | (3.480) |
| 21.139 | Primo Water Corp | Goldman Sachs | (27.903) | (11.176) | Progyny Inc | HSBC | (20.538) |
| 24.627 | Primo Water Corp | HSBC | (32.015) | 8.389 | Progyny Inc | HSBC | 25.187 |
| 7.441 | Primo Water Corp | Morgan Stanley | (6.548) | (4.931) | Progyny Inc | Morgan Stanley | 4.044 |
| 10.150 | Primoris Services Corp | Bank of America Merrill Lynch | 19.488 | 15.757 | Prologis Inc (REIT) | Barclays Bank | 3.152 |
| 9.665 | Primoris Services Corp | Barclays Bank | (4.253) | 1.521 | Prologis Inc (REIT) | Morgan Stanley | 304 |
| 13.969 | Primoris Services Corp | Goldman Sachs | 26.820 | 46.491 | ProPetro Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.579 |
| 2.318 | Primoris Services Corp | Morgan Stanley | (1.020) | 81.872 | ProPetro Holding Corp | Barclays Bank | (61.404) |
| (3.469) | Princeton Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.706) | 16.098 | ProPetro Holding Corp | Goldman Sachs | 1.932 |
| (1.049) | Princeton Bancorp Inc | HSBC | 556 | 47.973 | ProPetro Holding Corp | HSBC | 7.676 |
| (416) | Princeton Bancorp Inc | Morgan Stanley | (200) | (9.876) | ProPhase Labs Inc | Bank of America Merrill Lynch | (15.209) |
| 2.764 | Principal Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.233) | 3.345 | PROS Holdings Inc | Barclays Bank | 3.780 |
| (27.946) | Principal Financial Group Inc | Barclays Bank | 114.858 | 3.576 | PROS Holdings Inc | Goldman Sachs | 13.732 |
| 8.466 | Principal Financial Group Inc | Barclays Bank | (32.206) | 5.258 | PROS Holdings Inc | HSBC | 17.351 |
| 3.488 | Principal Financial Group Inc | Goldman Sachs | (15.430) | 6.369 | PROS Holdings Inc | Morgan Stanley | 7.197 |
| 5.978 | Principal Financial Group Inc | HSBC | (27.085) | 6.878 | Prosperity Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17.952) |
| 879 | Principal Financial Group Inc | Morgan Stanley | (3.613) | (21.111) | Prosperity Bancshares Inc | Barclays Bank | 63.966 |
| (4.456) | Priority Technology Holdings Inc | Barclays Bank | (156) | 2.547 | Prosperity Bancshares Inc | HSBC | (3.721) |
| (5.580) | Privia Health Group Inc | Barclays Bank | 6.710 | 1.933 | Prosperity Bancshares Inc | Morgan Stanley | (4.721) |
| 13.789 | Privia Health Group Inc | Barclays Bank | (22.200) | (5.264) | Protagonist Therapeutics Inc | HSBC | (1.895) |
| (1.961) | Privia Health Group Inc | HSBC | 3.155 | 1.723 | Protara Therapeutics Inc | HSBC | (379) |
| 1.314 | Privia Health Group Inc | HSBC | (6.990) | (15.993) | Proterra Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.638 |
| 3.835 | Privia Health Group Inc | Morgan Stanley | (6.174) | (63.417) | Proterra Inc | Barclays Bank | 10.147 |
| | | | | (43.383) | Proterra Inc | HSBC | 17.353 |
| | | | | (55.057) | Proterra Inc | Morgan Stanley | 8.809 |
| | | | | (5.686) | Prothena Corp Plc | Barclays Bank | 49.013 |
| | | | | (10.626) | Proto Labs Inc | Barclays Bank | 18.170 |
| | | | | (5.262) | Proto Labs Inc | Goldman Sachs | 2.263 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|---|---|-------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.100) | Proto Labs Inc | HSBC | (567) | (11.001) | PureCycle Technologies Inc | HSBC | 3.630 |
| (16.855) | Provident Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 674 | (2.456) | PureCycle Technologies Inc | Morgan Stanley | 196 |
| (22.531) | Provident Bancorp Inc | Goldman Sachs | 901 | (48.174) | Purple Innovation Inc | Barclays Bank | 2.409 |
| (5.242) | Provident Bancorp Inc | HSBC | (5.557) | (26.402) | Purple Innovation Inc | HSBC | (14.785) |
| (5.966) | Provident Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.923 | (32.042) | Purple Innovation Inc | Morgan Stanley | 1.602 |
| (17.179) | Provident Financial Holdings Inc | Barclays Bank | (3.779) | 1.550 | PVH Corp | Bank of America Merrill Lynch | (295) |
| (11.153) | Provident Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 5.465 | (891) | PVH Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.779 |
| (24.034) | Provident Financial Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (21.871) | (624) | PVH Corp | Barclays Bank | 12 |
| (25.742) | Provident Financial Services Inc | Barclays Bank | 5.406 | (1.796) | PVH Corp | Morgan Stanley | 5.584 |
| (20.181) | Provident Financial Services Inc | HSBC | (14.957) | 7.746 | Q2 Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 22.308 |
| (46.175) | Provident Financial Services Inc | Morgan Stanley | 9.697 | 14.003 | Q2 Holdings Inc | Barclays Bank | 8.076 |
| (2.386) | PTC Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.571) | 37.022 | Q2 Holdings Inc | Goldman Sachs | 105.506 |
| (8.044) | PTC Inc | Barclays Bank | 13.072 | 4.424 | Q2 Holdings Inc | HSBC | 26.854 |
| (2.405) | PTC Inc | Goldman Sachs | (5.616) | 6.043 | Q2 Holdings Inc | Morgan Stanley | 3.284 |
| (8.707) | PTC Inc | HSBC | (30.368) | (2.244) | QCR Holdings Inc | Barclays Bank | 1.032 |
| (3.697) | PTC Inc | Morgan Stanley | 6.008 | (19.992) | QCR Holdings Inc | HSBC | (32.987) |
| 1.207 | PTC Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17.151) | (573) | QCR Holdings Inc | Morgan Stanley | 264 |
| 1.180 | PTC Therapeutics Inc | Barclays Bank | (21.252) | 9.640 | QIAGEN NV | Bank of America Merrill Lynch | (3.181) |
| 1.681 | PTC Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (23.887) | 8.270 | QIAGEN NV | Barclays Bank | 744 |
| 3.791 | PTC Therapeutics Inc | HSBC | (54.818) | (1.809) | QIAGEN NV | Barclays Bank | (163) |
| 4.815 | PTC Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (86.718) | 28.390 | QIAGEN NV | Goldman Sachs | (9.369) |
| (1.511) | Public Service Enterprise Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.938 | (1.161) | QIAGEN NV | Goldman Sachs | 138 |
| (40.637) | Public Service Enterprise Group Inc | Barclays Bank | 116.628 | 7.114 | QIAGEN NV | HSBC | (7.399) |
| (14.590) | Public Service Enterprise Group Inc | Goldman Sachs | 46.542 | (4.059) | Qorvo Inc | Barclays Bank | (8.544) |
| (44.597) | Public Service Enterprise Group Inc | HSBC | 184.186 | (4.982) | Qorvo Inc | Goldman Sachs | (25.931) |
| 1.915 | Public Storage (REIT) | Barclays Bank | 2.049 | (4.005) | Qorvo Inc | HSBC | (16.240) |
| 182 | Public Storage (REIT) | Goldman Sachs | (1.531) | (21.708) | Quad/Graphics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.605 |
| 1.071 | Public Storage (REIT) | HSBC | (11.616) | (9.969) | Quad/Graphics Inc | Barclays Bank | 4.785 |
| 3.423 | Public Storage (REIT) | Morgan Stanley | 3.663 | (14.003) | Quad/Graphics Inc | Goldman Sachs | 1.680 |
| 12.772 | PubMatic Inc 'A' | Goldman Sachs | 24.522 | (40.861) | Quad/Graphics Inc | HSBC | (21.248) |
| 7.712 | PubMatic Inc 'A' | HSBC | 6.773 | (9.963) | Quad/Graphics Inc | Morgan Stanley | 4.782 |
| (4.764) | Pulmonx Corp | Bank of America Merrill Lynch | 7.289 | 709 | Quaker Chemical Corp | Barclays Bank | (9.657) |
| (11.982) | Pulmonx Corp | Barclays Bank | 12.102 | 683 | Quaker Chemical Corp | Goldman Sachs | (4.568) |
| (815) | Pulmonx Corp | Goldman Sachs | 1.247 | 5.115 | Quaker Chemical Corp | Morgan Stanley | (59.237) |
| (1.644) | Pulmonx Corp | HSBC | 1.365 | 5.190 | QUALCOMM Inc | Bank of America Merrill Lynch | 42.275 |
| (9.785) | Pulse Biosciences Inc | Goldman Sachs | 19.570 | 5.961 | QUALCOMM Inc | Barclays Bank | 53.338 |
| (296) | Pulse Biosciences Inc | Morgan Stanley | 74 | 1.159 | QUALCOMM Inc | Goldman Sachs | 8.368 |
| (5.593) | PulteGroup Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.305 | 1.464 | QUALCOMM Inc | Morgan Stanley | 13.287 |
| (7.472) | PulteGroup Inc | Barclays Bank | 7.995 | 431 | Qualys Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.892 |
| 10.410 | PulteGroup Inc | Morgan Stanley | (11.139) | (2.060) | Qualys Inc | Barclays Bank | (8.528) |
| 7.298 | Puma Biotechnology Inc | Barclays Bank | 1.788 | (3.555) | Qualys Inc | Goldman Sachs | (32.102) |
| 57.504 | Puma Biotechnology Inc | Goldman Sachs | 20.414 | 1.061 | Qualys Inc | Goldman Sachs | 9.581 |
| (5.464) | Pure Cycle Corp | Barclays Bank | 710 | 2.707 | Qualys Inc | HSBC | 29.831 |
| (50.404) | Pure Cycle Corp | Goldman Sachs | 10.081 | (464) | Qualys Inc | HSBC | (5.113) |
| (25.017) | Pure Cycle Corp | HSBC | (12.759) | 665 | Qualys Inc | Morgan Stanley | 2.753 |
| 2.935 | Pure Storage Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 16.436 | (11.511) | Quanex Building Products Corp | Bank of America Merrill Lynch | (7.677) |
| 7.245 | Pure Storage Inc 'A' | Barclays Bank | 31.733 | (8.777) | Quanex Building Products Corp | Barclays Bank | 878 |
| 15.379 | Pure Storage Inc 'A' | Goldman Sachs | 86.122 | (20.916) | Quanex Building Products Corp | HSBC | (26.684) |
| 2.662 | Pure Storage Inc 'A' | HSBC | 17.223 | (6.671) | Quanex Building Products Corp | Morgan Stanley | (1.130) |
| (2.959) | PureCycle Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (829) | (13.085) | Quanta Services Inc | Barclays Bank | (115.410) |
| (12.844) | PureCycle Technologies Inc | Barclays Bank | 1.028 | (7.350) | Quanta Services Inc | Goldman Sachs | (36.750) |
| (4.095) | PureCycle Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.147) | (11.337) | Quanta Services Inc | HSBC | (123.913) |
| | | | | 1.987 | Quanterix Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.769 |
| | | | | 6.478 | Quanterix Corp | Morgan Stanley | 4.211 |
| | | | | (21.407) | Quantum Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.551) |
| | | | | (16.400) | Quantum Corp | Barclays Bank | 656 |
| | | | | (22.726) | Quantum Corp | Goldman Sachs | (3.770) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 29.758 | Quantum-Si Inc | Barclays Bank | (5.505) | (5.011) | Ramaco Resources Inc | Bank of America | |
| (3.763) | Quest Diagnostics Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 10.172 |
| | | Merrill Lynch | (2.973) | (20.275) | Ramaco Resources Inc | Barclays Bank | 30.615 |
| 4.405 | Quest Diagnostics Inc | Barclays Bank | 6.916 | (12.038) | Ramaco Resources Inc | Goldman Sachs | 24.437 |
| (3.256) | Quest Diagnostics Inc | Goldman Sachs | (2.572) | (8.845) | Ramaco Resources Inc | HSBC | 22.643 |
| (7.443) | Quest Diagnostics Inc | HSBC | 11.462 | 4.693 | Rambus Inc | Bank of America | |
| 1.952 | Quest Diagnostics Inc | HSBC | (3.006) | | | Merrill Lynch | 37.417 |
| (2.588) | Quest Diagnostics Inc | Morgan Stanley | (4.063) | 7.800 | Rambus Inc | Barclays Bank | 48.282 |
| 375 | Quest Diagnostics Inc | Morgan Stanley | 589 | 3.702 | Rambus Inc | Goldman Sachs | 36.336 |
| (2.583) | Quidel Corp | Bank of America | | (4.714) | Rambus Inc | HSBC | (70.380) |
| | | Merrill Lynch | 3.952 | 2.696 | Rambus Inc | Morgan Stanley | 16.688 |
| (1.205) | Quidel Corp | Barclays Bank | 4.446 | (5.067) | Range Resources Corp | Bank of America | |
| (7.871) | Quidel Corp | Goldman Sachs | 12.043 | | | Merrill Lynch | 10.729 |
| (6.988) | Quidel Corp | HSBC | 18.797 | (19.869) | Range Resources Corp | Barclays Bank | 42.917 |
| (1.463) | Quidel Corp | Morgan Stanley | 5.399 | 2.200 | Range Resources Corp | Barclays Bank | (4.752) |
| 11.648 | QuinStreet Inc | Barclays Bank | (1.514) | (21.518) | Range Resources Corp | Goldman Sachs | 430 |
| 27.115 | QuinStreet Inc | Goldman Sachs | 47.722 | (10.366) | Range Resources Corp | HSBC | (20.317) |
| 5.695 | QuinStreet Inc | Morgan Stanley | (740) | (15.963) | Range Resources Corp | Morgan Stanley | 29.453 |
| 5.829 | Quipt Home Medical Corp | Barclays Bank | (5.654) | 3.386 | Ranger Energy Services Inc | Goldman Sachs | 711 |
| 4.692 | Quipt Home Medical Corp | HSBC | (490) | 9.263 | Ranger Energy Services Inc | Morgan Stanley | (5.836) |
| 7.410 | Quipt Home Medical Corp | Morgan Stanley | (4.244) | (7.540) | Ranger Oil Corp | Bank of America | |
| (10.637) | Quotient Technology Inc | Barclays Bank | 2.553 | | | Merrill Lynch | 9.727 |
| (11.499) | Quotient Technology Inc | Goldman Sachs | 575 | (11.549) | Ranger Oil Corp | Barclays Bank | 23.791 |
| (3.076) | Quotient Technology Inc | HSBC | 738 | (7.997) | Ranger Oil Corp | Goldman Sachs | 10.316 |
| 1.097 | Qurate Retail Inc (Pref) | Goldman Sachs | (1.020) | (8.611) | Ranger Oil Corp | HSBC | 17.911 |
| 599 | Qurate Retail Inc (Pref) | HSBC | (1.426) | (10.118) | Ranger Oil Corp | Morgan Stanley | 20.843 |
| 330 | Qurate Retail Inc (Pref) | Morgan Stanley | (587) | (66.813) | Ranpak Holdings Corp | Barclays Bank | 24.053 |
| (16.657) | Qurate Retail Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.906 | (17.327) | Ranpak Holdings Corp | Goldman Sachs | 6.238 |
| (24.675) | Qurate Retail Inc 'A' | Morgan Stanley | 664 | (4.113) | Ranpak Holdings Corp | Morgan Stanley | 1.481 |
| (21.335) | R1 RCM Inc | Bank of America | | 940 | Rapid7 Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 640 | | | Merrill Lynch | 733 |
| (29.207) | R1 RCM Inc | Barclays Bank | 15.772 | 25.074 | Rapid7 Inc | Barclays Bank | 99.043 |
| (41.536) | R1 RCM Inc | Goldman Sachs | 1.246 | 423 | Rapid7 Inc | HSBC | (55) |
| (56.153) | R1 RCM Inc | HSBC | (7.155) | (11.713) | RAPT Therapeutics Inc | Barclays Bank | 14.407 |
| (47.427) | R1 RCM Inc | Morgan Stanley | 25.611 | (4.604) | Raymond James Financial Inc | Bank of America | |
| 29.222 | Rackspace Technology Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (17.493) |
| | | Merrill Lynch | 13.004 | (23.454) | Raymond James Financial Inc | Barclays Bank | (31.854) |
| 13.098 | Rackspace Technology Inc | Barclays Bank | 1.113 | | | Barclays Bank | |
| 7.094 | Rackspace Technology Inc | Goldman Sachs | 3.157 | 3.534 | Raymond James Financial Inc | Barclays Bank | 4.736 |
| (44.212) | Radian Group Inc | Bank of America | | (1.091) | Raymond James Financial Inc | HSBC | (2.537) |
| | | Merrill Lynch | (38.464) | (7.298) | Raymond James Financial Inc | Morgan Stanley | (9.879) |
| (35.601) | Radian Group Inc | Barclays Bank | (15.665) | | | | |
| 9.259 | Radian Group Inc | Barclays Bank | 4.074 | (21.854) | Rayonier Advanced Materials Inc | Barclays Bank | 18.794 |
| (18.758) | Radian Group Inc | Goldman Sachs | (16.319) | 633 | Rayonier Inc (REIT) | Bank of America | |
| (42.891) | Radian Group Inc | HSBC | (45.464) | | | Merrill Lynch | (411) |
| (29.358) | Radian Group Inc | Morgan Stanley | (13.112) | 7.344 | Rayonier Inc (REIT) | Barclays Bank | (4.700) |
| 21.589 | Radiant Logistics Inc | Bank of America | | (13.419) | Rayonier Inc (REIT) | Barclays Bank | 8.588 |
| | | Merrill Lynch | (1.295) | 3.825 | Rayonier Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.486) |
| 26.454 | Radiant Logistics Inc | Barclays Bank | (6.349) | 3.254 | Rayonier Inc (REIT) | HSBC | (2.310) |
| 22.515 | Radiant Logistics Inc | Goldman Sachs | (1.351) | (3.222) | Rayonier Inc (REIT) | HSBC | 2.288 |
| 46.536 | Radiant Logistics Inc | HSBC | (7.911) | (6.588) | RB Global Inc | Morgan Stanley | 21.543 |
| 44.633 | Radiant Logistics Inc | Morgan Stanley | (10.712) | (1.383) | RBB Bancorp | Bank of America | |
| (13.230) | Radius Global Infrastructure Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.646) |
| | | Merrill Lynch | (1.521) | (7.358) | RBB Bancorp | Barclays Bank | 883 |
| (9.977) | Radius Global Infrastructure Inc 'A' | Barclays Bank | (449) | (7.182) | RBB Bancorp | Goldman Sachs | (8.547) |
| (5.155) | Radius Global Infrastructure Inc 'A' | Goldman Sachs | (593) | (12.956) | RBB Bancorp | HSBC | (22.932) |
| (13.767) | RadNet Inc | Barclays Bank | (9.775) | (19.082) | RBC Bearings Inc | Barclays Bank | 238.715 |
| (16.350) | Rafael Holdings Inc 'B' | Barclays Bank | (1.799) | (11.147) | RBC Bearings Inc | Goldman Sachs | 191.171 |
| (12.818) | Rafael Holdings Inc 'B' | Goldman Sachs | (2.051) | (3.236) | RBC Bearings Inc | HSBC | 61.430 |
| (2.725) | Rafael Holdings Inc 'B' | HSBC | (136) | (6.609) | RBC Bearings Inc | Morgan Stanley | 82.679 |
| (1.904) | Rafael Holdings Inc 'B' | Morgan Stanley | (209) | (1.088) | RCI Hospitality Holdings Inc | Goldman Sachs | 54 |
| (2.633) | Rain Oncology Inc | Barclays Bank | 369 | (1.206) | RCI Hospitality Holdings Inc | HSBC | 2.328 |
| 3.865 | Ralph Lauren Corp | Bank of America | | (3.124) | RCM Technologies Inc | Barclays Bank | — |
| | | Merrill Lynch | (26.282) | (4.857) | RCM Technologies Inc | Goldman Sachs | (8.840) |
| 22.743 | Ralph Lauren Corp | Barclays Bank | (53.901) | (2.617) | RE/MAX Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 1.309 |
| 3.229 | Ralph Lauren Corp | Goldman Sachs | (21.957) | (7.043) | RE/MAX Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 916 |
| 7.419 | Ralph Lauren Corp | HSBC | (39.247) | (22.599) | RE/MAX Holdings Inc 'A' | HSBC | 7.458 |
| 11.194 | Ralph Lauren Corp | Morgan Stanley | (26.530) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (497) | Reading International Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 75 | 1.890 | Regency Centers Corp (REIT) | Barclays Bank | (61) |
| (30.500) | Reading International Inc 'A' | HSBC | 8.845 | 18.491 | Regency Centers Corp (REIT) | Goldman Sachs | (59.541) |
| (10.422) | Ready Capital Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (984) | 35.122 | Regency Centers Corp (REIT) | HSBC | (113.434) |
| (103.923) | Ready Capital Corp (REIT) | Barclays Bank | 53.902 | 13.144 | Regency Centers Corp (REIT) | Morgan Stanley | (25.401) |
| (66.087) | Ready Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | 5.946 | 379 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.243) |
| (90.876) | Ready Capital Corp (REIT) | HSBC | 4.301 | 806 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (13.432) |
| (12.492) | Ready Capital Corp (REIT) | Morgan Stanley | 3.869 | 260 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (4.920) |
| (27.713) | RealReal Inc | Bank of America Merrill Lynch | (416) | 743 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | HSBC | (14.576) |
| (8.842) | RealReal Inc | HSBC | 486 | 428 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (8.410) |
| (19.640) | Realty Income Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 48.943 | 26.573 | REGENXBIO Inc | Goldman Sachs | (7.399) |
| (81.229) | Realty Income Corp (REIT) | Barclays Bank | 107.565 | 25.157 | REGENXBIO Inc | HSBC | (31.888) |
| (19.045) | Realty Income Corp (REIT) | Goldman Sachs | 56.373 | 4.283 | Regional Management Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.142 |
| (14.600) | Realty Income Corp (REIT) | HSBC | 43.505 | 7.980 | Regional Management Corp | Barclays Bank | (479) |
| (4.041) | Realty Income Corp (REIT) | Morgan Stanley | 5.320 | 13.736 | Regional Management Corp | Goldman Sachs | 6.868 |
| (1.127) | Reata Pharmaceuticals Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (6.955) | 7.106 | Regional Management Corp | HSBC | (2.061) |
| (322) | Reata Pharmaceuticals Inc 'A' | Barclays Bank | (3.249) | 22.079 | Regional Management Corp | Morgan Stanley | (1.325) |
| (475) | Reata Pharmaceuticals Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.332) | (32.497) | Regions Financial Corp | HSBC | (42.896) |
| (610) | Reata Pharmaceuticals Inc 'A' | HSBC | 9.315 | (42.521) | Regions Financial Corp | Morgan Stanley | (8.929) |
| (1.151) | Reata Pharmaceuticals Inc 'A' | Morgan Stanley | (11.614) | 744 | Reinsurance Group of America Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.331) |
| 5.476 | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 17.030 | 3.525 | Reinsurance Group of America Inc | Barclays Bank | (29.927) |
| 7.139 | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | Barclays Bank | 4.212 | 9.216 | Reinsurance Group of America Inc | Goldman Sachs | (78.428) |
| 19.631 | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | Goldman Sachs | 61.052 | 403 | Reinsurance Group of America Inc | Morgan Stanley | (883) |
| 14.372 | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | HSBC | 44.697 | (59.920) | Rekor Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (15.579) |
| 9.029 | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.327 | (24.176) | Rekor Systems Inc | Barclays Bank | 967 |
| (7.878) | Red River Bancshares Inc | Barclays Bank | (2.757) | (4.322) | Rekor Systems Inc | HSBC | (692) |
| (5.008) | Red River Bancshares Inc | Goldman Sachs | (29.848) | (226) | Rekor Systems Inc | Morgan Stanley | 9 |
| (3.874) | Red River Bancshares Inc | HSBC | (24.639) | 13.380 | Relay Therapeutics Inc | Barclays Bank | (3.880) |
| (5.086) | Red River Bancshares Inc | Morgan Stanley | (1.780) | 7.095 | Relay Therapeutics Inc | HSBC | (71) |
| (13.157) | Red Robin Gourmet Burgers Inc | Morgan Stanley | 18.551 | 11.793 | Relay Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (3.420) |
| 2.940 | Red Rock Resorts Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (3.557) | 330 | Reliance Steel & Aluminum Co | Bank of America Merrill Lynch | (4.086) |
| (533) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 247 | 331 | Reliance Steel & Aluminum Co | Barclays Bank | (4.098) |
| 4.094 | Red Rock Resorts Inc 'A' | Barclays Bank | (7.041) | (17.679) | Relmada Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.475 |
| (364) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Barclays Bank | 300 | (4.406) | Relmada Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.630 |
| 5.663 | Red Rock Resorts Inc 'A' | HSBC | (12.402) | (9.251) | Relmada Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.295 |
| (3.549) | Red Rock Resorts Inc 'A' | HSBC | 7.772 | (5.930) | Relmada Therapeutics Inc | HSBC | 3.499 |
| (5.498) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Morgan Stanley | (9.457) | (891) | Remitly Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.337 |
| (2.461) | Red Rock Resorts Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.700 | (1.843) | Remitly Global Inc | Barclays Bank | 2.304 |
| (9.248) | Red Violet Inc | Barclays Bank | 25.987 | (5.268) | Remitly Global Inc | HSBC | 3.582 |
| (2.028) | Red Violet Inc | HSBC | (6.632) | (9.404) | Remitly Global Inc | Morgan Stanley | 11.755 |
| 7.417 | Redfin Corp | Barclays Bank | (10.013) | 1.245 | RenaissanceRe Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (15.367) |
| (49.923) | Redwood Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | 1.498 | 899 | RenaissanceRe Holdings Ltd | Barclays Bank | (292) |
| (66.897) | Redwood Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (14.048) | 1.698 | RenaissanceRe Holdings Ltd | HSBC | (26.468) |
| (18.721) | Redwood Trust Inc (REIT) | HSBC | (2.059) | (9.866) | Renasant Corp | Bank of America Merrill Lynch | (17.660) |
| (3.527) | Regal Rexnord Corp | Bank of America Merrill Lynch | (13.561) | (15.477) | Renasant Corp | Barclays Bank | (2.012) |
| (3.307) | Regal Rexnord Corp | Barclays Bank | 5.853 | (26.983) | Renasant Corp | Goldman Sachs | (48.300) |
| 1.307 | Regal Rexnord Corp | Barclays Bank | (2.313) | | | | |
| 606 | Regal Rexnord Corp | Goldman Sachs | 2.273 | | | | |
| (4.331) | Regal Rexnord Corp | HSBC | (12.036) | | | | |
| (6.661) | Regal Rexnord Corp | Morgan Stanley | 11.789 | | | | |
| 6.015 | Regency Centers Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (19.368) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (16.378) | Renasant Corp | HSBC | (17.033) | (1.142) | Revvity Inc | Barclays Bank | 4.954 |
| (5.956) | Renasant Corp | Morgan Stanley | (774) | (789) | Revvity Inc | HSBC | 1.596 |
| 549 | Reneo Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (15.504) | Revvity Inc | Morgan Stanley | 79.226 |
| | | Merrill Lynch | (55) | (7.769) | REX American Resources Corp | Barclays Bank | (23.152) |
| 670 | Reneo Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (74) | | REX American Resources Corp | Goldman Sachs | (41.578) |
| 519 | Reneo Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (57) | (8.217) | REX American Resources Corp | HSBC | (6.395) |
| 7.976 | Rent the Runway Inc 'A' | Morgan Stanley | (4.307) | (1.120) | REX American Resources Corp | Bank of America | (384) |
| (18.799) | Rentech Inc | Morgan Stanley | 56 | 17.055 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Merrill Lynch | (384) |
| 19.357 | Repay Holdings Corp | Bank of America | | 6.196 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Barclays Bank | 2.937 |
| | | Merrill Lynch | (19.744) | 6.373 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.723 |
| 8.577 | Repay Holdings Corp | Barclays Bank | (5.747) | 17.986 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | HSBC | (18.207) |
| 23.079 | Repay Holdings Corp | Goldman Sachs | (23.541) | 17.381 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Morgan Stanley | 9.163 |
| 18.107 | Repay Holdings Corp | HSBC | (2.535) | 15.091 | Reynolds Consumer Products Inc | Barclays Bank | (5.885) |
| (4.528) | Repligen Corp | Bank of America | | 3.424 | Reynolds Consumer Products Inc | HSBC | (103) |
| | | Merrill Lynch | (76.885) | (5.830) | RGC Resources Inc | Bank of America | |
| (2.655) | Repligen Corp | Barclays Bank | (10.480) | | RGC Resources Inc | Merrill Lynch | (13.526) |
| 269 | Repligen Corp | Barclays Bank | 1.149 | (6.892) | RGC Resources Inc | Barclays Bank | (14.818) |
| (478) | Repligen Corp | HSBC | (6.893) | (7.553) | RGC Resources Inc | Goldman Sachs | (17.523) |
| (820) | Repligen Corp | Morgan Stanley | (3.817) | (7.122) | RGC Resources Inc | HSBC | (13.104) |
| 5.467 | Replimune Group Inc | Bank of America | | (1.568) | RH | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 656 | | RH | Merrill Lynch | 19.835 |
| 13.574 | Replimune Group Inc | HSBC | 10.136 | (6.379) | RH | Barclays Bank | 30.046 |
| 3.047 | Replimune Group Inc | Morgan Stanley | (2.559) | (3.035) | RH | Goldman Sachs | 38.393 |
| (1.840) | Republic Bancorp Inc 'A' | Bank of America | | (2.171) | RH | HSBC | 11.810 |
| | | Merrill Lynch | (7.047) | (2.109) | RH | Morgan Stanley | 9.933 |
| (10.733) | Republic Bancorp Inc 'A' | Barclays Bank | (25.008) | 11.002 | Ribbon Communications Inc | Barclays Bank | (1.430) |
| (11.740) | Republic Bancorp Inc 'A' | Goldman Sachs | (44.964) | 20.885 | Ribbon Communications Inc | Goldman Sachs | 3.550 |
| (4.459) | Republic Bancorp Inc 'A' | HSBC | (17.791) | 25.696 | Ribbon Communications Inc | HSBC | 5.396 |
| 57.961 | Republic First Bancorp Inc | Barclays Bank | (1.159) | (8.755) | Richardson Electronics Ltd | Barclays Bank | 14.796 |
| (174) | Republic Services Inc | Barclays Bank | 331 | (5.399) | Richardson Electronics Ltd | Goldman Sachs | 1.890 |
| (6.948) | Republic Services Inc | Morgan Stanley | 13.201 | 9.295 | Richmond Mutual BanCorp Inc | Barclays Bank | (2.556) |
| (14.831) | Research Frontiers Inc | Barclays Bank | (1.186) | 25.124 | Richmond Mutual BanCorp Inc | Goldman Sachs | 18.592 |
| (14.789) | Research Frontiers Inc | HSBC | (2.958) | 17.568 | Rigel Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| (66.270) | Research Frontiers Inc | Morgan Stanley | (5.302) | | Rigel Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (88) |
| 2.614 | Reservoir Media Inc | Morgan Stanley | 131 | 11.375 | Rigel Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (2.332) |
| (2.909) | Resideo Technologies Inc | Bank of America | | 12.254 | Rigel Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (61) |
| | | Merrill Lynch | 1.251 | 20.972 | Rigel Pharmaceuticals Inc | HSBC | 3.041 |
| (31.697) | Resideo Technologies Inc | Barclays Bank | 29.478 | (21.112) | Riley Exploration Permian Inc | Goldman Sachs | 125.194 |
| (2.726) | Resideo Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.172 | (1.423) | Riley Exploration Permian Inc | HSBC | 15.667 |
| (27.093) | Resideo Technologies Inc | HSBC | 6.773 | (1.357) | Riley Exploration Permian Inc | Morgan Stanley | 7.287 |
| (7.231) | Resideo Technologies Inc | Morgan Stanley | 6.725 | (10.720) | Rimini Street Inc | Barclays Bank | (4.717) |
| 9.098 | ResMed Inc | Barclays Bank | (153.301) | (15.143) | Rimini Street Inc | Goldman Sachs | (11.206) |
| (539) | ResMed Inc | Barclays Bank | 9.082 | (18.298) | Rimini Street Inc | HSBC | (9.881) |
| (996) | ResMed Inc | HSBC | 23.994 | (210.824) | Ring Energy Inc | Bank of America | |
| (181) | ResMed Inc | Morgan Stanley | 3.050 | (57.522) | Ring Energy Inc | Merrill Lynch | 14.758 |
| 2.631 | Resolute Forest Products Inc | Goldman Sachs | — | (116.173) | Ring Energy Inc | HSBC | 6.903 |
| | | Barclays Bank | 10.786 | 29.703 | RingCentral Inc 'A' | Morgan Stanley | 20.911 |
| (28.385) | Resources Connection Inc | Barclays Bank | 10.786 | | RingCentral Inc 'A' | Bank of America | |
| (9.537) | Resources Connection Inc | HSBC | (3.383) | 25.659 | RingCentral Inc 'A' | Merrill Lynch | 192.475 |
| (10.490) | Resources Connection Inc | Morgan Stanley | 2.650 | 6.338 | RingCentral Inc 'A' | Barclays Bank | 73.384 |
| (4.311) | Retail Opportunity Investments Corp (REIT) | Bank of America | | 7.642 | RingCentral Inc 'A' | HSBC | 51.908 |
| | | Merrill Lynch | 1.768 | (23.392) | Riot Platforms Inc | Morgan Stanley | 21.856 |
| (11.514) | Retail Opportunity Investments Corp (REIT) | HSBC | 6.825 | (55.117) | Rite Aid Corp | Barclays Bank | 8.421 |
| (15.885) | REV Group Inc | Bank of America | | (4.512) | Rite Aid Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (2.383) | | | Merrill Lynch | 4.961 |
| (62.565) | REV Group Inc | Barclays Bank | 14.390 | | | Goldman Sachs | 406 |
| (43.925) | REV Group Inc | Goldman Sachs | (6.589) | | | | |
| (9.345) | REV Group Inc | HSBC | 2.804 | | | | |
| (21.835) | REV Group Inc | Morgan Stanley | 5.022 | | | | |
| (3.090) | Revanche Therapeutics Inc | Barclays Bank | 6.551 | | | | |
| (8.916) | REVOLUTION Medicines Inc | Barclays Bank | 12.572 | | | | |
| (8.375) | REVOLUTION Medicines Inc | Goldman Sachs | 10.553 | | | | |
| 16.676 | Revolve Group Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (3.991) | | | | |
| 5.460 | Revolve Group Inc | Morgan Stanley | (147) | | | | |
| (2.492) | Revvity Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 9.069 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (51.067) | Rite Aid Corp | Morgan Stanley | 9.192 | 7.520 | Rollins Inc | Bank of America | |
| (208.642) | Rithm Capital Corp (REIT) | Barclays Bank | 8.346 | | | Merrill Lynch | (18.833) |
| (259.543) | Rithm Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | (36.336) | 22.414 | Rollins Inc | Barclays Bank | (33.640) |
| (40.949) | Rithm Capital Corp (REIT) | HSBC | (9.009) | 14.965 | Rollins Inc | Goldman Sachs | (42.768) |
| 81.353 | Riverview Bancorp Inc | Bank of America | | 32.583 | Rollins Inc | HSBC | (87.159) |
| | | Merrill Lynch | 43.117 | 39.469 | Rollins Inc | Morgan Stanley | (66.900) |
| 22.637 | Riverview Bancorp Inc | Goldman Sachs | 11.998 | (17.265) | Root Inc 'A' | Barclays Bank | — |
| 19.835 | Riverview Bancorp Inc | Morgan Stanley | 7.934 | (57) | Roper Technologies Inc | Barclays Bank | 299 |
| (58.589) | Rivian Automotive Inc 'A' | Bank of America | | (7.214) | Roper Technologies Inc | Goldman Sachs | 68.639 |
| | | Merrill Lynch | (74.994) | (165) | Roper Technologies Inc | HSBC | 1.026 |
| (9.618) | Rivian Automotive Inc 'A' | Goldman Sachs | (12.311) | (6.506) | Ross Stores Inc | Bank of America | |
| (34.588) | Rivian Automotive Inc 'A' | Morgan Stanley | (16.948) | | | Merrill Lynch | 12.557 |
| (1.625) | RLI Corp | Bank of America | | (4.361) | Ross Stores Inc | Goldman Sachs | 8.417 |
| | | Merrill Lynch | 10.418 | (1.974) | Ross Stores Inc | HSBC | (1.021) |
| (7.384) | RLI Corp | Barclays Bank | 29.876 | (7.851) | Ross Stores Inc | Morgan Stanley | 16.958 |
| (726) | RLI Corp | Goldman Sachs | 939 | 12.151 | Rover Group Inc | Barclays Bank | 214 |
| (17.264) | RLI Corp | HSBC | 200.378 | 6.229 | Rover Group Inc | Goldman Sachs | 12 |
| (22.889) | RLI Corp | Morgan Stanley | 108.036 | 30.688 | Rover Group Inc | HSBC | (3.864) |
| 56.843 | RLJ Lodging Trust (REIT) | Bank of America | | 20.644 | Rover Group Inc | Morgan Stanley | 246 |
| | | Merrill Lynch | (28.990) | 1.094 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Bank of America | |
| 19.738 | RLJ Lodging Trust (REIT) | Barclays Bank | (9.277) | | | Merrill Lynch | 4.453 |
| 33.081 | RLJ Lodging Trust (REIT) | Goldman Sachs | (11.506) | 3.918 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Barclays Bank | (528) |
| 61.422 | RLJ Lodging Trust (REIT) | HSBC | (33.782) | | | | |
| 50.818 | RLJ Lodging Trust (REIT) | Morgan Stanley | (19.057) | 1.366 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Goldman Sachs | 1.821 |
| 35.929 | RMR Group Inc 'A' | Barclays Bank | (9.342) | 1.815 | Royal Caribbean Cruises Ltd | HSBC | 4.783 |
| 7.100 | RMR Group Inc 'A' | HSBC | (4.189) | | | | |
| (6.216) | Roadrunner Transportation Systems Inc | Bank of America | | 3.715 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Morgan Stanley | 5.623 |
| | | Merrill Lynch | (5.532) | (1.361) | Royal Gold Inc | Goldman Sachs | 20.388 |
| 2.443 | Robert Half International Inc | Bank of America | | 2.764 | Royal Gold Inc | Morgan Stanley | (18.132) |
| | | Merrill Lynch | (4.693) | 5.993 | Royalty Pharma Plc 'A' | Bank of America | |
| 6.046 | Robert Half International Inc | Barclays Bank | (12.341) | | | Merrill Lynch | (10.068) |
| 1.513 | Robert Half International Inc | Goldman Sachs | (4.238) | (2.043) | Royalty Pharma Plc 'A' | Bank of America | |
| (20.093) | Robinhood Markets Inc 'A' | Barclays Bank | (4.420) | | | Merrill Lynch | 3.432 |
| 2.390 | Robinhood Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | 891 | 6.016 | Royalty Pharma Plc 'A' | Barclays Bank | (4.392) |
| (10.209) | Robinhood Markets Inc 'A' | HSBC | (715) | (9.828) | Royalty Pharma Plc 'A' | Barclays Bank | 7.174 |
| (158) | ROBLOX Corp 'A' | Bank of America | | 10.763 | Royalty Pharma Plc 'A' | Goldman Sachs | (18.082) |
| | | Merrill Lynch | (221) | 10.050 | Royalty Pharma Plc 'A' | HSBC | (28.844) |
| 10.630 | ROBLOX Corp 'A' | Barclays Bank | 9.354 | (2.063) | Royalty Pharma Plc 'A' | HSBC | 5.921 |
| (866) | ROBLOX Corp 'A' | HSBC | (3.542) | 48.886 | Royalty Pharma Plc 'A' | Morgan Stanley | (35.687) |
| 3.744 | ROBLOX Corp 'A' | Morgan Stanley | 3.295 | (10.669) | Royalty Pharma Plc 'A' | Morgan Stanley | 7.788 |
| (1.442) | ROBLOX Corp 'A' | Morgan Stanley | (1.269) | 41.434 | RPC Inc | Bank of America | |
| (89.158) | Rocket Lab USA Inc | Barclays Bank | 36.109 | | | Merrill Lynch | (7.458) |
| (70.961) | Rocket Lab USA Inc | HSBC | (49.318) | 10.155 | RPC Inc | Barclays Bank | (5.687) |
| (69.562) | Rocket Lab USA Inc | Morgan Stanley | 28.173 | 1.635 | RPC Inc | Goldman Sachs | (294) |
| (14.175) | Rocket Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 18.286 | 5.291 | RPC Inc | HSBC | (1.058) |
| (11.683) | Rocket Pharmaceuticals Inc | HSBC | 8.645 | 20.423 | RPC Inc | Morgan Stanley | (11.437) |
| (1.240) | Rocket Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 1.600 | 5.235 | RPM International Inc | Barclays Bank | (105) |
| (2.046) | Rockwell Automation Inc | Barclays Bank | 2.005 | (14.189) | RPM International Inc | Goldman Sachs | 14.331 |
| 371 | Rockwell Automation Inc | Goldman Sachs | (1.761) | 2.436 | RPM International Inc | Goldman Sachs | (2.460) |
| (1.010) | Rockwell Automation Inc | Goldman Sachs | (7.424) | 1.337 | RPM International Inc | HSBC | (1.070) |
| 559 | Rockwell Automation Inc | Morgan Stanley | 4.502 | 2.628 | RPM International Inc | Morgan Stanley | (53) |
| (1.880) | Rockwell Automation Inc | Morgan Stanley | 1.842 | 67.561 | RPT Realty (REIT) | Barclays Bank | (8.783) |
| (1.810) | Rockwell Medical Inc | Bank of America | | 84.117 | RPT Realty (REIT) | Goldman Sachs | 9.253 |
| | | Merrill Lynch | (688) | 54.376 | RPT Realty (REIT) | HSBC | 2.175 |
| (725) | Rockwell Medical Inc | Barclays Bank | (160) | (2.607) | RumbleON Inc 'B' | Bank of America | |
| (7.942) | Rockwell Medical Inc | Morgan Stanley | (1.747) | | | Merrill Lynch | (4.093) |
| (3.097) | Rocky Brands Inc | Bank of America | | (26.024) | RumbleON Inc 'B' | Barclays Bank | 5.465 |
| | | Merrill Lynch | (1.239) | (10.894) | RumbleON Inc 'B' | Morgan Stanley | 2.288 |
| (6.844) | Rocky Brands Inc | Barclays Bank | (3.354) | 28.675 | Rush Enterprises Inc 'A' | Barclays Bank | 8.029 |
| (5.884) | Rocky Brands Inc | Goldman Sachs | (2.354) | 7.337 | Rush Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.467 |
| (8.198) | Rocky Brands Inc | HSBC | 1.886 | 11.183 | Rush Enterprises Inc 'B' | Barclays Bank | (3.355) |
| (3.266) | Rogers Corp | Barclays Bank | — | 5.451 | Rush Enterprises Inc 'B' | Goldman Sachs | 4.742 |
| (7.049) | Rogers Corp | HSBC | 24.178 | 2.169 | Rush Enterprises Inc 'B' | HSBC | 4.707 |
| 5.841 | Roku Inc | Bank of America | | 153 | Rush Enterprises Inc 'B' | Morgan Stanley | (46) |
| | | Merrill Lynch | 19.158 | 12.521 | Rush Street Interactive Inc | Bank of America | |
| 9.650 | Roku Inc | Barclays Bank | 6.562 | | | Merrill Lynch | (1.878) |
| 651 | Roku Inc | Goldman Sachs | 2.135 | 26.002 | Rush Street Interactive Inc | Barclays Bank | (9.101) |
| 6.848 | Roku Inc | HSBC | 10.888 | | | | |
| 3.084 | Roku Inc | Morgan Stanley | 2.097 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 17.990 | Rush Street Interactive Inc | Goldman Sachs | (2.699) | (11.950) | Safety Insurance Group Inc | Goldman Sachs | (54.373) |
| 9.299 | Rush Street Interactive Inc | Morgan Stanley | (3.255) | (3.087) | Safety Insurance Group Inc | HSBC | (12.718) |
| 3.125 | Ruth's Hospitality Group Inc | Bank of America | | 6.123 | Saga Communications Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.776) |
| | | Merrill Lynch | 203 | | | | |
| 14.047 | Ruth's Hospitality Group Inc | Barclays Bank | 351 | 235 | Saga Communications Inc 'A' | HSBC | (414) |
| 29.507 | RXO Inc | Bank of America | | 1.547 | Saga Communications Inc 'A' | Morgan Stanley | 588 |
| | | Merrill Lynch | 43.080 | | | Barclays Bank | 21.583 |
| 16.567 | RXO Inc | Barclays Bank | 11.100 | (6.501) | Sage Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 3.535 |
| 33.919 | RXO Inc | Goldman Sachs | 49.522 | (1.091) | Sage Therapeutics Inc | HSBC | 4.423 |
| 5.264 | RXO Inc | HSBC | 6.896 | (3.137) | Sage Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 16.545 | RXO Inc | Morgan Stanley | 11.085 | (112) | Saia Inc | Merrill Lynch | (740) |
| (2.098) | RxSight Inc | Barclays Bank | 2.455 | (2.815) | Saia Inc | Barclays Bank | (25.195) |
| (23.333) | RxSight Inc | Goldman Sachs | (52.966) | 712 | Saia Inc | Goldman Sachs | 4.706 |
| (16.059) | Ryan Specialty Holdings Inc | Bank of America | | 264 | Saia Inc | HSBC | (1.238) |
| | | Merrill Lynch | 64.878 | 2.122 | Salesforce Inc | Barclays Bank | 21.475 |
| (18.319) | Ryan Specialty Holdings Inc | Goldman Sachs | 74.009 | (2.397) | Salesforce Inc | Barclays Bank | (24.258) |
| (4.872) | Ryan Specialty Holdings Inc | HSBC | 16.029 | 1.921 | Salesforce Inc | HSBC | 43.184 |
| (30.790) | Ryan Specialty Holdings Inc | Morgan Stanley | 129.626 | 2.119 | Salesforce Inc | Morgan Stanley | 21.444 |
| 5.671 | Ryder System Inc | Barclays Bank | (6.408) | (1.164) | Salesforce Inc | Morgan Stanley | (11.780) |
| 1.232 | Ryerson Holding Corp | Bank of America | | 9.129 | Salisbury Bancorp Inc | Barclays Bank | (9.312) |
| | | Merrill Lynch | (1.388) | 5.287 | Salisbury Bancorp Inc | Goldman Sachs | 7.666 |
| 1.363 | Ryerson Holding Corp | Barclays Bank | (3.298) | (5.462) | Sally Beauty Holdings Inc | Barclays Bank | (1.693) |
| 5.229 | Ryerson Holding Corp | Goldman Sachs | (3.556) | (8.297) | Sally Beauty Holdings Inc | Goldman Sachs | 249 |
| 7.705 | Ryerson Holding Corp | HSBC | (7.501) | (5.904) | Sally Beauty Holdings Inc | HSBC | (649) |
| 1.849 | Ryerson Holding Corp | Morgan Stanley | (4.219) | (4.606) | Samsara Inc 'A' | Bank of America | |
| 4.714 | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Bank of America | | | Samsara Inc 'A' | Merrill Lynch | 2.111 |
| | | Merrill Lynch | (17.913) | (3.621) | Samsara Inc 'A' | Barclays Bank | 3.078 |
| (563) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | 1.019 | (1.736) | Samsara Inc 'A' | HSBC | (146) |
| 4.200 | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (7.602) | (17.355) | Samsara Inc 'A' | Morgan Stanley | 11.546 |
| 5.648 | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (21.462) | 20.640 | Sana Biotechnology Inc | Barclays Bank | (34.882) |
| (808) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3.070 | (786) | Sanara Medtech Inc | Bank of America | |
| 14.705 | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | HSBC | (59.996) | (859) | Sanara Medtech Inc | Merrill Lynch | 6.319 |
| (1.273) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | HSBC | 5.194 | (2.391) | Sanara Medtech Inc | Barclays Bank | 2.122 |
| (769) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.392 | 11.726 | SandRidge Energy Inc | Morgan Stanley | 5.906 |
| 1.770 | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (3.204) | 14.030 | Sandy Spring Bancorp Inc | Barclays Bank | (45.966) |
| 2.976 | S&P Global Inc | Barclays Bank | (31.218) | 35.753 | Sangamo Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 393 | S&P Global Inc | HSBC | 2.625 | | Sangamo Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (6.793) |
| 2.192 | S&P Global Inc | Morgan Stanley | (22.994) | 117.275 | Sangamo Therapeutics Inc | Barclays Bank | (24.628) |
| (17.308) | S&T Bancorp Inc | Bank of America | | 66.785 | Sangamo Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (12.689) |
| | | Merrill Lynch | (8.461) | 44.952 | Sangamo Therapeutics Inc | HSBC | (5.394) |
| (6.540) | S&T Bancorp Inc | Barclays Bank | 1.086 | 41.204 | Sangamo Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (8.653) |
| (3.059) | S&T Bancorp Inc | HSBC | (831) | 13.860 | Sanmina Corp | Barclays Bank | 34.234 |
| (8.580) | S&T Bancorp Inc | Morgan Stanley | 1.474 | 27.555 | Sanmina Corp | HSBC | 14.053 |
| (66.317) | Sabra Health Care Inc (REIT) | Bank of America | | (11.995) | Sapiens International Corp NV | Barclays Bank | (8.756) |
| | | Barclays Bank | 5.968 | (1.286) | Sapiens International Corp NV | HSBC | (2.958) |
| (48.960) | Sabra Health Care Inc (REIT) | Goldman Sachs | 22.522 | (50.320) | Sarcos Technology & Robotics Corp | HSBC | 669 |
| (30.674) | Sabra Health Care Inc (REIT) | HSBC | 17.632 | (6.039) | Sarcos Technology & Robotics Corp | Morgan Stanley | (195) |
| (9.928) | Sabra Health Care Inc (REIT) | Morgan Stanley | 894 | (366) | Sarepta Therapeutics Inc | Barclays Bank | 9.026 |
| (7.933) | Sabre Corp | Bank of America | | (186) | Sarepta Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 4.592 |
| | | Merrill Lynch | 2.737 | (2.192) | Sarepta Therapeutics Inc | HSBC | 53.385 |
| (40.849) | Sabre Corp | Barclays Bank | 20.629 | (187) | Sarepta Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 4.611 |
| (936) | Sabre Corp | HSBC | 548 | (21.417) | Saul Centers Inc (REIT) | Barclays Bank | 29.555 |
| (70.186) | Sabre Corp | Morgan Stanley | 35.444 | (5.580) | Saul Centers Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.065 |
| (20.670) | Safe Bulkers Inc | Barclays Bank | 9.508 | (58.571) | Savara Inc | Barclays Bank | (2.343) |
| (18.078) | Safe Bulkers Inc | Goldman Sachs | 5.966 | (2.370) | SB Financial Group Inc | Barclays Bank | (616) |
| (52.013) | Safe Bulkers Inc | HSBC | 24.966 | 2.008 | SBA Communications Corp (REIT) | Bank of America | |
| (120.812) | Safeguard Scientifics Inc | Bank of America | | 1.786 | SBA Communications Corp (REIT) | Merrill Lynch | (29.598) |
| | | Merrill Lynch | 8.457 | 4.855 | SBA Communications Corp (REIT) | Barclays Bank | (28.433) |
| (7.047) | Safety Insurance Group Inc | Barclays Bank | (6.413) | 9.844 | SBA Communications Corp (REIT) | HSBC | (61.124) |
| | | | | | | Morgan Stanley | (156.716) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 6.704 | ScanSource Inc | Bank of America Merrill Lynch | (939) | (154) | Seaboard Corp | Morgan Stanley | 7.856 |
| 17.892 | ScanSource Inc | Barclays Bank | (11.809) | 16 | Seaboard Corp | Morgan Stanley | (816) |
| 3.337 | ScanSource Inc | Goldman Sachs | (467) | (5.399) | SeaChange International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 260 |
| 1.913 | ScanSource Inc | HSBC | 4.323 | 7.778 | SEACOR Marine Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.167 |
| 7.656 | Schlumberger NV | Bank of America Merrill Lynch | (8.412) | (7.434) | Seagate Technology Holdings Plc | Barclays Bank | 28.844 |
| 1.605 | Schlumberger NV | Barclays Bank | (4.414) | (13.615) | Seagate Technology Holdings Plc | HSBC | (29.440) |
| (5.031) | Schlumberger NV | Morgan Stanley | 13.835 | (4.405) | Sealed Air Corp | Bank of America Merrill Lynch | 17.528 |
| 2.920 | Schlumberger NV | Morgan Stanley | (8.030) | (31.598) | Sealed Air Corp | Barclays Bank | 118.177 |
| 5.259 | Schneider National Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (2.261) | (25.733) | Sealed Air Corp | Goldman Sachs | 113.225 |
| 58.821 | Schneider National Inc 'B' | Barclays Bank | (9.411) | (9.895) | Sealed Air Corp | HSBC | 47.249 |
| 31.453 | Schneider National Inc 'B' | Goldman Sachs | (13.525) | (14.886) | Sealed Air Corp | Morgan Stanley | 55.674 |
| 38.162 | Schneider National Inc 'B' | HSBC | (20.226) | (541) | SeaWorld Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | (997) |
| 57.776 | Schneider National Inc 'B' | Morgan Stanley | (9.244) | (17.193) | SeaWorld Entertainment Inc | Barclays Bank | 6.516 |
| 7.762 | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Barclays Bank | (14.670) | (7.120) | SeaWorld Entertainment Inc | HSBC | 966 |
| 18.269 | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Goldman Sachs | (13.154) | (1.405) | SecureWorks Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 183 |
| 12.181 | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Morgan Stanley | (23.022) | (14.162) | SecureWorks Corp 'A' | Morgan Stanley | 7.647 |
| 7.283 | Scholar Rock Holding Corp | Barclays Bank | (12.527) | 6.283 | Security National Financial Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (660) |
| 8.731 | Scholar Rock Holding Corp | Goldman Sachs | (22.351) | 27.425 | Security National Financial Corp 'A' | Barclays Bank | 20.980 |
| (9.648) | Scholastic Corp | Bank of America Merrill Lynch | (5.982) | 26.946 | Security National Financial Corp 'A' | Goldman Sachs | (2.829) |
| (925) | Scholastic Corp | Barclays Bank | 444 | 5.378 | Security National Financial Corp 'A' | HSBC | (350) |
| (5.994) | Scholastic Corp | HSBC | (24.276) | 9.301 | Security National Financial Corp 'A' | Morgan Stanley | 7.115 |
| (1.969) | Schrodinger Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14.256) | (2.073) | Seelos Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 91 |
| (2.860) | Schrodinger Inc | Barclays Bank | 11.526 | (11.310) | Seelos Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.465 |
| (1.230) | Schrodinger Inc | HSBC | (8.831) | 31.471 | Seer Inc | Bank of America Merrill Lynch | 14.162 |
| (5.815) | Schrodinger Inc | Morgan Stanley | 23.434 | 11.924 | Seer Inc | Barclays Bank | (2.385) |
| (10.801) | Science Applications International Corp | Barclays Bank | 6.583 | 21.635 | Seer Inc | Goldman Sachs | 9.736 |
| (6.325) | Science Applications International Corp | Goldman Sachs | 10.879 | 16.967 | Seer Inc | HSBC | 3.224 |
| (15.703) | Science Applications International Corp | HSBC | 28.108 | 36.245 | Seer Inc | Morgan Stanley | (7.249) |
| (13.364) | Science Applications International Corp | Morgan Stanley | 2.143 | 1.846 | SEI Investments Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.285) |
| 8.656 | Scilex Holding Co' | HSBC | 49.329 | 17.217 | SEI Investments Co | Barclays Bank | (10.369) |
| 5.438 | Scilex Holding Co | HSBC | 3.807 | 9.492 | SEI Investments Co | Goldman Sachs | (9.777) |
| 16.388 | Sciplay Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 50.803 | 12.031 | SEI Investments Co | HSBC | (4.322) |
| 28.898 | Sciplay Corp 'A' | HSBC | 73.910 | (2.327) | Select Medical Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.513 |
| 23.327 | Sciplay Corp 'A' | Morgan Stanley | (3.732) | (42.299) | Select Medical Holdings Corp | Barclays Bank | 57.950 |
| 6.624 | Scorpio Tankers Inc | Barclays Bank | (18.481) | (6.411) | Select Medical Holdings Corp | Goldman Sachs | 6.924 |
| 2.694 | Scorpio Tankers Inc | Morgan Stanley | (6.869) | (14.306) | Select Medical Holdings Corp | HSBC | 37.339 |
| 3.052 | Scotts Miracle-Gro Co | Bank of America Merrill Lynch | (13.377) | (3.307) | Select Water Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 761 |
| 1.023 | Scotts Miracle-Gro Co | Barclays Bank | (2.569) | (42.493) | Select Water Solutions Inc | HSBC | 9.144 |
| 5.896 | Scotts Miracle-Gro Co | Goldman Sachs | (20.453) | (20.247) | Select Water Solutions Inc | Morgan Stanley | 10.124 |
| 8.757 | Scotts Miracle-Gro Co | HSBC | (73.471) | 38.000 | Selecta Biosciences Inc | Barclays Bank | (190) |
| 2.617 | Scotts Miracle-Gro Co | Morgan Stanley | (12.143) | 13.719 | Selecta Biosciences Inc | Goldman Sachs | (69) |
| (6.478) | scPharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.292 | (4.639) | Selective Insurance Group Inc | Barclays Bank | 17.628 |
| (15.143) | scPharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 13.174 | 10.041 | Selective Insurance Group Inc | Barclays Bank | (4.924) |
| (8.575) | Sculptor Capital Management Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.602) | (1.081) | Selective Insurance Group Inc | Goldman Sachs | 4.021 |
| (31.121) | Sculptor Capital Management Inc | Barclays Bank | (4.979) | 11.743 | Selectquote Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.697 |
| (28.643) | Sculptor Capital Management Inc | HSBC | (5.156) | 10.800 | Selectquote Inc | Barclays Bank | (3.240) |
| 9 | Seaboard Corp | Bank of America Merrill Lynch | 261 | | | | |
| 9 | Seaboard Corp | Barclays Bank | (459) | | | | |
| (69) | Seaboard Corp | Barclays Bank | 3.520 | | | | |
| (62) | Seaboard Corp | Goldman Sachs | (1.797) | | | | |
| 44 | Seaboard Corp | Goldman Sachs | 1.276 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 9.826 | Selectquote Inc | HSBC | 1.769 | 26.872 | SFL Corp Ltd | Barclays Bank | (2.687) |
| (1.441) | Semler Scientific Inc | Bank of America | | 23.244 | SFL Corp Ltd | Goldman Sachs | 697 |
| | | Merrill Lynch | 2.767 | 3.252 | Shake Shack Inc 'A' | Bank of America | |
| (217) | Semler Scientific Inc | Barclays Bank | 332 | | | Merrill Lynch | (15.967) |
| (491) | Semler Scientific Inc | Goldman Sachs | 943 | 6.803 | Shake Shack Inc 'A' | HSBC | 65.125 |
| 371 | Sempra Energy | Bank of America | | 18.575 | Sharecare Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (2.675) | | | Merrill Lynch | 557 |
| 1.311 | Sempra Energy | Barclays Bank | (3.618) | 15.265 | Sharecare Inc | Goldman Sachs | 458 |
| (10.667) | Sempra Energy | Goldman Sachs | 76.909 | 63.061 | Sharecare Inc | HSBC | — |
| 1.913 | Sempra Energy | Goldman Sachs | (13.793) | 16.471 | Shattuck Labs Inc | Barclays Bank | 3.953 |
| 2.303 | Sempra Energy | HSBC | (26.738) | 7.554 | Shattuck Labs Inc | Goldman Sachs | 1.737 |
| 5.978 | Sempra Energy | Morgan Stanley | (16.499) | 12.501 | Shattuck Labs Inc | HSBC | 1.750 |
| 23.982 | SEMrush Holdings Inc 'A' | Bank of America | | 1.636 | Shattuck Labs Inc | Morgan Stanley | 393 |
| | | Merrill Lynch | (29.498) | (18.822) | Shenandoah | | |
| 43.973 | SEMrush Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (32.100) | | Telecommunications Co | Barclays Bank | 19.575 |
| 18.546 | SEMrush Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (22.812) | (24.393) | Shenandoah | | |
| 9.061 | SEMrush Holdings Inc 'A' | HSBC | (21.656) | | Telecommunications Co | Goldman Sachs | 4.147 |
| 11.519 | SEMrush Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (8.409) | (16.364) | Shenandoah | | |
| 3.791 | Semtech Corp | Bank of America | | | Telecommunications Co | HSBC | (3.436) |
| | | Merrill Lynch | 9.629 | (3.267) | Shenandoah | | |
| 40.740 | Semtech Corp | Barclays Bank | (2.037) | | Telecommunications Co | Morgan Stanley | 3.398 |
| 22.735 | Semtech Corp | Goldman Sachs | 57.747 | 2.775 | Sherwin-Williams Co | Barclays Bank | (12.238) |
| 37.377 | Semtech Corp | HSBC | 108.020 | (1.641) | Sherwin-Williams Co | Barclays Bank | 7.237 |
| (2.518) | Seneca Foods Corp 'A' | Bank of America | | 2.086 | Shift4 Payments Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.612) | | | Merrill Lynch | (2.195) |
| (1.396) | Seneca Foods Corp 'A' | Barclays Bank | 1.005 | 892 | Shift4 Payments Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.325) |
| (2.723) | Seneca Foods Corp 'A' | Goldman Sachs | (1.743) | 985 | Shift4 Payments Inc 'A' | HSBC | 1.639 |
| (2.768) | Seneca Foods Corp 'A' | HSBC | (2.726) | 906 | Shift4 Payments Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.370) |
| (2.676) | Seneca Foods Corp 'A' | Morgan Stanley | 1.927 | (5.571) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Bank of America | |
| 2.363 | Sensata Technologies Holding Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 6.490 |
| | | Merrill Lynch | 2.020 | (20.080) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Barclays Bank | 12.349 |
| 1.686 | Sensata Technologies Holding Plc | Barclays Bank | 160 | 3.319 | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Barclays Bank | (2.041) |
| (2.997) | Sensata Technologies Holding Plc | Goldman Sachs | (2.562) | (5.418) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 6.312 |
| 957 | Sensata Technologies Holding Plc | HSBC | 522 | (17.774) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | HSBC | (67.986) |
| 3.137 | Sensata Technologies Holding Plc | Morgan Stanley | 298 | (9.707) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.970 |
| (126.106) | Senseonics Holdings Inc | HSBC | (1.312) | (884) | Shockwave Medical Inc | Bank of America | |
| 4.188 | Sensient Technologies Corp | Barclays Bank | (10.302) | | | Merrill Lynch | 2.997 |
| 12.864 | Sensient Technologies Corp | Goldman Sachs | (32.160) | 105 | Shockwave Medical Inc | Bank of America | |
| (4.836) | Sensus Healthcare Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (166) |
| | | Merrill Lynch | 774 | (1.838) | Shockwave Medical Inc | Barclays Bank | 13.387 |
| (4.199) | SentinelOne Inc 'A' | Barclays Bank | (8.818) | 799 | Shockwave Medical Inc | Barclays Bank | (6.088) |
| (10.733) | SentinelOne Inc 'A' | HSBC | (24.856) | 154 | Shockwave Medical Inc | HSBC | (519) |
| (25.964) | SentinelOne Inc 'A' | Morgan Stanley | (54.890) | (592) | Shockwave Medical Inc | Morgan Stanley | 4.511 |
| (3.890) | Seres Therapeutics Inc | Bank of America | | 2.870 | Shoe Carnival Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.256 | | | Merrill Lynch | (9.270) |
| (9.518) | Seres Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 1.618 | 2.412 | Shoe Carnival Inc | Barclays Bank | (3.907) |
| (14.769) | Seritage Growth Properties 'A' (REIT) | Bank of America | | 3.536 | Shoe Carnival Inc | Goldman Sachs | (9.189) |
| | | Merrill Lynch | 1.547 | 5.569 | Shoe Carnival Inc | HSBC | (16.261) |
| (25.057) | Seritage Growth Properties 'A' (REIT) | Barclays Bank | 3.542 | 3.308 | Shoe Carnival Inc | Morgan Stanley | (5.539) |
| (19.234) | Seritage Growth Properties 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 3.462 | 22.461 | Shore Bancshares Inc | Bank of America | |
| (8.320) | Service Corp International | Barclays Bank | 9.901 | 42.618 | Shore Bancshares Inc | Merrill Lynch | 11.231 |
| (8.466) | Service Corp International | Morgan Stanley | 10.075 | 43.859 | Shore Bancshares Inc | Barclays Bank | (5.967) |
| (21.336) | Service Properties Trust (REIT) | Barclays Bank | (2.774) | 47.662 | Shore Bancshares Inc | Goldman Sachs | 21.929 |
| 1.699 | ServiceNow Inc | Barclays Bank | 57.681 | 17.752 | Shore Bancshares Inc | HSBC | 4.469 |
| 261 | ServiceNow Inc | Morgan Stanley | 8.861 | 5.805 | Shutterstock Inc | Morgan Stanley | (2.485) |
| (4.532) | ServisFirst Bancshares Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.583 | 12.393 | Shutterstock Inc | Merrill Lynch | (34.017) |
| (9.162) | ServisFirst Bancshares Inc | Barclays Bank | 31.792 | 1.879 | Shutterstock Inc | Barclays Bank | (85.016) |
| (5.046) | ServisFirst Bancshares Inc | Goldman Sachs | 2.876 | 13.398 | Shutterstock Inc | Goldman Sachs | (11.011) |
| (21.824) | ServisFirst Bancshares Inc | HSBC | 110.211 | (9.028) | Shyft Group Inc | HSBC | (82.532) |
| (5.515) | ServisFirst Bancshares Inc | Morgan Stanley | 19.137 | 1.891 | SI-BONE Inc | HSBC | (15.438) |
| (11.721) | SES AI Corp | Morgan Stanley | 1.055 | | | Bank of America | |
| (149.481) | Sesen Bio Inc | Morgan Stanley | | 1.387 | SI-BONE Inc | Merrill Lynch | 785 |
| | | Barclays Bank | (1) | 7.167 | SI-BONE Inc | Barclays Bank | (2.254) |
| | | | | | | Goldman Sachs | 2.974 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.429 | SI-BONE Inc | HSBC | 4.108 | (25.420) | Simply Good Foods Co | Morgan Stanley | 11.947 |
| (73.799) | Siebert Financial Corp | Barclays Bank | 1.476 | (9.947) | Simpson Manufacturing Co Inc | Barclays Bank | 42.573 |
| (760) | Siebert Financial Corp | Goldman Sachs | (76) | (4.743) | Simpson Manufacturing Co Inc | Goldman Sachs | 24.569 |
| (1.050) | Siebert Financial Corp | HSBC | (158) | (11.760) | Simpson Manufacturing Co Inc | HSBC | 66.208 |
| (659) | Siebert Financial Corp | Morgan Stanley | 13 | (9.788) | Simulations Plus Inc | Barclays Bank | (18.108) |
| 777 | Sienna Biopharmaceuticals Inc [†] | Goldman Sachs | — | (17.697) | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | Barclays Bank | 16.458 |
| 12.659 | Sierra Bancorp | Goldman Sachs | 8.988 | 10.668 | Singular Genomics Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.680 |
| 53.366 | Sierra Bancorp | Morgan Stanley | (9.606) | 12.284 | Singular Genomics Systems Inc | Barclays Bank | 123 |
| (10.010) | SIGA Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.802 | 20.273 | Singular Genomics Systems Inc | Goldman Sachs | 3.193 |
| (6.782) | SIGA Technologies Inc | Barclays Bank | (136) | 2.717 | Singular Genomics Systems Inc | HSBC | — |
| (12.856) | SIGA Technologies Inc | HSBC | 1.157 | 6.848 | Singular Genomics Systems Inc | Morgan Stanley | 68 |
| (6.222) | SIGA Technologies Inc | Morgan Stanley | (124) | 11.428 | Sirius XM Holdings Inc | Goldman Sachs | 114 |
| (6.299) | Sight Sciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.535 | (74.659) | SiriusPoint Ltd | Barclays Bank | (2.986) |
| (9.627) | Sight Sciences Inc | Barclays Bank | 289 | (40.605) | SITE Centers Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 10.963 |
| (5.366) | Sight Sciences Inc | Goldman Sachs | 3.864 | (35.883) | SITE Centers Corp (REIT) | Barclays Bank | 15.071 |
| (11.476) | Sight Sciences Inc | HSBC | 14.115 | (52.178) | SITE Centers Corp (REIT) | Goldman Sachs | 14.088 |
| (2.509) | Sight Sciences Inc | Morgan Stanley | 75 | (39.049) | SITE Centers Corp (REIT) | HSBC | 9.362 |
| 682 | Sigilon Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.091) | (79.411) | SITE Centers Corp (REIT) | Morgan Stanley | 33.353 |
| 180 | Sigilon Therapeutics Inc | Barclays Bank | (331) | (1.269) | SiteOne Landscape Supply Inc | Barclays Bank | 11.840 |
| 1.082 | Sigilon Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.732) | 2.161 | SiteOne Landscape Supply Inc | Goldman Sachs | (24.484) |
| 326 | Sigilon Therapeutics Inc | HSBC | (786) | (384) | SiteOne Landscape Supply Inc | Goldman Sachs | 4.351 |
| 851 | Sigilon Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.559) | 1.347 | SiteOne Landscape Supply Inc | HSBC | (19.127) |
| 5.653 | Signet Jewelers Ltd | Barclays Bank | (41.606) | (884) | SiteOne Landscape Supply Inc | Morgan Stanley | 8.248 |
| (2.442) | Silgan Holdings Inc | Barclays Bank | 5.055 | (1.241) | SiTime Corp | Goldman Sachs | (18.044) |
| (8.897) | Silgan Holdings Inc | Goldman Sachs | 21.531 | (2.517) | SiTime Corp | HSBC | (37.126) |
| 5.524 | Silgan Holdings Inc | HSBC | (13.589) | (13.614) | Sitio Royalties Corp 'A' | Barclays Bank | 15.384 |
| 4.892 | Silgan Holdings Inc | Morgan Stanley | (10.126) | (1.230) | Sitio Royalties Corp 'A' | Goldman Sachs | 554 |
| 1.004 | Silicon Laboratories Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7.871 | (174.104) | Sitio Royalties Corp 'A' | Morgan Stanley | 193.529 |
| (1.593) | Silicon Laboratories Inc | Barclays Bank | (4.508) | (14.402) | SITO Mobile Ltd | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 4.455 | Silicon Laboratories Inc | Barclays Bank | 12.608 | (66.470) | SITO Mobile Ltd [†] | Goldman Sachs | — |
| 1.960 | Silicon Laboratories Inc | Goldman Sachs | 15.366 | (1.097) | Six Flags Entertainment Corp | Bank of America Merrill Lynch | 234 |
| 1.275 | Silicon Laboratories Inc | HSBC | 9.009 | (5.440) | Six Flags Entertainment Corp | Barclays Bank | 5.766 |
| (624) | Silicon Laboratories Inc | HSBC | (4.530) | (1.111) | Six Flags Entertainment Corp | Morgan Stanley | 1.178 |
| (129) | Silicon Laboratories Inc | Morgan Stanley | (365) | 7.584 | Six Flags Entertainment Corp | Morgan Stanley | (8.039) |
| 2.871 | Silicon Laboratories Inc | Morgan Stanley | 8.125 | (717) | SJW Group | Bank of America Merrill Lynch | (924) |
| (3.403) | Silk Road Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.941 | (5.916) | SJW Group | Barclays Bank | (8.249) |
| (5.440) | Silk Road Medical Inc | Barclays Bank | 8.051 | (2.518) | SJW Group | Goldman Sachs | (579) |
| (5.879) | Silk Road Medical Inc | Goldman Sachs | 26.691 | (14.202) | SJW Group | HSBC | (7.318) |
| (2.116) | Silk Road Medical Inc | Morgan Stanley | 3.162 | (4.083) | SJW Group | Morgan Stanley | (4.494) |
| (14.285) | SilverBow Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.571 | 3.160 | Skechers USA Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (825) |
| (6.088) | SilverBow Resources Inc | Barclays Bank | 11.324 | 12.051 | Skechers USA Inc 'A' | HSBC | 16 |
| (2.423) | SilverBow Resources Inc | HSBC | (1.526) | 4.769 | Skechers USA Inc 'A' | Morgan Stanley | (95) |
| (1.530) | SilverBow Resources Inc | Morgan Stanley | 2.846 | (158.559) | Skillsoft Corp | Goldman Sachs | (22.198) |
| 3.474 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.293 | 41.250 | Skillz Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.788) |
| 11.782 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | Barclays Bank | — | 133.800 | Skillz Inc | Barclays Bank | (7.506) |
| 10.185 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 6.722 | (80.046) | Skillz Inc | Barclays Bank | 4.491 |
| 8.630 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | HSBC | 14.930 | 16.940 | Skillz Inc | Goldman Sachs | (1.145) |
| 20.245 | SilverCrest Asset Management Group Inc 'A' | Morgan Stanley | — | | | | |
| 8.584 | Simmons First National Corp 'A' | Goldman Sachs | 9.786 | | | | |
| 981 | Simmons First National Corp 'A' | HSBC | 1.158 | | | | |
| 22.943 | Simon Property Group Inc (REIT) | HSBC | (96.819) | | | | |
| 10.401 | Simon Property Group Inc (REIT) | Morgan Stanley | (22.882) | | | | |
| (4.235) | Simply Good Foods Co | Barclays Bank | 1.990 | | | | |
| (1.227) | Simply Good Foods Co | HSBC | 3.309 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 42.173 | Skillz Inc | HSBC | (5.158) | (26.682) | Snap One Holdings Corp | Morgan Stanley | 12.274 |
| 17.608 | Skillz Inc | Morgan Stanley | (988) | 15.712 | Snap-on Inc | Barclays Bank | (131.509) |
| 4.741 | Sky Harbour Group Corp | Bank of America | | 9.473 | Snap-on Inc | Goldman Sachs | (45.849) |
| | | Merrill Lynch | (1.517) | 595 | Snap-on Inc | Morgan Stanley | (4.980) |
| 2.111 | Sky Harbour Group Corp | Barclays Bank | (701) | (5.111) | Snowflake Inc 'A' | Barclays Bank | 66.289 |
| 2.541 | Sky Harbour Group Corp | Goldman Sachs | (813) | (588) | Snowflake Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.851 |
| 2.113 | Sky Harbour Group Corp | Morgan Stanley | (702) | (999) | Snowflake Inc 'A' | Morgan Stanley | 12.957 |
| (166) | Skyline Champion Corp | Bank of America | | (31.919) | Societal CDMO Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.004 | | | Merrill Lynch | (2.873) |
| 665 | Skyline Champion Corp | Bank of America | | (41.295) | Societal CDMO Inc | Barclays Bank | (1.239) |
| | | Merrill Lynch | (8.027) | (45.995) | Societal CDMO Inc | Goldman Sachs | (4.140) |
| (3.736) | Skyline Champion Corp | Barclays Bank | 36.613 | (3.123) | Societal CDMO Inc | HSBC | (156) |
| 773 | Skyline Champion Corp | Goldman Sachs | (9.330) | (7.345) | Societal CDMO Inc | Morgan Stanley | (220) |
| (2.456) | Skyline Champion Corp | HSBC | 42.538 | (3.634) | SoFi Technologies Inc | Bank of America | |
| 3.282 | Skyline Champion Corp | HSBC | (56.844) | | | Merrill Lynch | (7.086) |
| (3.778) | Skyline Champion Corp | Morgan Stanley | 37.025 | (37.755) | SoFi Technologies Inc | Barclays Bank | (55.122) |
| (4.496) | Skyward Specialty Insurance Group Inc | Barclays Bank | 1.034 | (67.075) | SoFi Technologies Inc | HSBC | (83.844) |
| 11.267 | SkyWest Inc | Barclays Bank | 19.041 | (153.304) | SoFi Technologies Inc | Morgan Stanley | (223.824) |
| 3.327 | SkyWest Inc | HSBC | 9.482 | (2.853) | SolarEdge Technologies Inc | Barclays Bank | 31.840 |
| 11.937 | SkyWest Inc | Morgan Stanley | 20.174 | (401) | SolarEdge Technologies Inc | Morgan Stanley | 4.475 |
| (6.246) | Skyworks Solutions Inc | Bank of America | | 30.073 | Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (30.043) | 28.255 | Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A' | Merrill Lynch | (5.112) |
| (34.831) | Skyworks Solutions Inc | Barclays Bank | (62.696) | 2.741 | Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A' | Barclays Bank | (15.540) |
| (9.617) | Skyworks Solutions Inc | Goldman Sachs | (46.258) | 8.451 | Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A' | Goldman Sachs | (466) |
| (8.224) | Skyworks Solutions Inc | Morgan Stanley | (14.803) | 15.727 | Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A' | HSBC | (930) |
| 1.046 | SL Green Realty Corp (REIT) | Bank of America | | (45.231) | SolarWinds Corp | Morgan Stanley | (8.650) |
| | | Merrill Lynch | 962 | (2.093) | Solenio Therapeutics Inc | Barclays Bank | 4.071 |
| (1.182) | SL Green Realty Corp (REIT) | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.087) | (7.562) | Solenio Therapeutics Inc | Merrill Lynch | (2.135) |
| (9.469) | SL Green Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | 4.450 | 4.417 | Solid Biosciences Inc | Barclays Bank | 302 |
| 13.045 | SL Green Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | 12.001 | 5.803 | Solid Biosciences Inc | Barclays Bank | 640 |
| 11.878 | SL Green Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | (5.583) | 2.700 | Solid Biosciences Inc | Goldman Sachs | (203) |
| (17.009) | SL Green Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | 7.994 | 3.066 | Solid Biosciences Inc | HSBC | 2.174 |
| (1.310) | Sleep Number Corp | Bank of America | | 3.066 | Solid Biosciences Inc | Morgan Stanley | 445 |
| | | Merrill Lynch | 3.668 | (22.170) | Solid Power Inc | HSBC | 222 |
| (3.229) | Sleep Number Corp | Goldman Sachs | 9.041 | (40.330) | Solid Power Inc | Morgan Stanley | 1.210 |
| (37.826) | SLM Corp | Barclays Bank | (12.104) | (28.961) | Solid Power Inc | Morgan Stanley | 29.540 |
| (33.604) | SLM Corp | Goldman Sachs | (13.106) | 9.437 | Solo Brands Inc 'A' | Morgan Stanley | |
| (11.648) | SLM Corp | HSBC | (10.716) | | SomaLogic Inc | Bank of America | |
| (5.441) | SLM Corp | Morgan Stanley | (1.741) | 25.400 | SomaLogic Inc | Merrill Lynch | (1.793) |
| 11.220 | SM Energy Co | Bank of America | | 33.762 | SomaLogic Inc | Barclays Bank | (9.398) |
| | | Merrill Lynch | (4.376) | 48.462 | SomaLogic Inc | Goldman Sachs | (6.415) |
| 55.925 | SM Energy Co | Barclays Bank | (111.850) | (15.802) | Sonder Holdings Inc | HSBC | 1.454 |
| 14.350 | SM Energy Co | Goldman Sachs | (5.596) | (21.911) | Sonder Holdings Inc | HSBC | (2.648) |
| 41.597 | SM Energy Co | HSBC | (10.815) | 4.763 | Sonic Automotive Inc 'A' | Morgan Stanley | (206) |
| 45.653 | SM Energy Co | Morgan Stanley | (91.306) | (5.893) | Sonida Senior Living Inc | Bank of America | |
| 2.919 | SmartFinancial Inc | Bank of America | | (406) | Sonoco Products Co | Merrill Lynch | 5.049 |
| | | Merrill Lynch | 5.371 | | | Bank of America | (4.891) |
| 12.913 | SmartFinancial Inc | Barclays Bank | 129 | (3.016) | Sonoco Products Co | Bank of America | |
| 53.818 | SmartFinancial Inc | Goldman Sachs | 99.025 | (10.103) | Sonoco Products Co | Merrill Lynch | (300) |
| 5.483 | SmartFinancial Inc | HSBC | 8.334 | (11.681) | Sonoco Products Co | Barclays Bank | 717 |
| 4.380 | SmartFinancial Inc | Morgan Stanley | 44 | (15.650) | Sonos Inc | HSBC | (2.923) |
| (156.565) | SmartRent Inc | Morgan Stanley | (4.697) | | | Morgan Stanley | 4.966 |
| 1.391 | Smartsheet Inc 'A' | Barclays Bank | 1.822 | (26.206) | Sonos Inc | Bank of America | |
| 537 | Smartsheet Inc 'A' | HSBC | 4.720 | (9.091) | Sonos Inc | Merrill Lynch | 4.249 |
| 1.597 | Smartsheet Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.092 | (16.913) | Sonos Inc | Barclays Bank | (3.973) |
| (125.050) | Smith Micro Software Inc | Barclays Bank | 5.002 | (5.549) | Sonos Inc | Goldman Sachs | 3.545 |
| (40.607) | Smith Micro Software Inc | Goldman Sachs | — | (6.170) | Sotera Health Co | HSBC | 112.133 |
| (41.062) | Smith Micro Software Inc | HSBC | 3.696 | | | Morgan Stanley | (1.709) |
| (3.069) | Snap Inc 'A' | Barclays Bank | (675) | (11.244) | Sotera Health Co | Bank of America | |
| 34.782 | Snap Inc 'A' | HSBC | 54.260 | (42.184) | Sotera Health Co | Merrill Lynch | 7.836 |
| 79.296 | Snap Inc 'A' | Morgan Stanley | 17.445 | (2.719) | SoundThinking Inc | Barclays Bank | 6.746 |
| (9.970) | Snap Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.193) | (1.879) | SoundThinking Inc | Goldman Sachs | 53.574 |
| (26.113) | Snap One Holdings Corp | Goldman Sachs | 28.985 | (9.482) | SoundThinking Inc | Barclays Bank | 54 |
| (3.611) | Snap One Holdings Corp | HSBC | 2.600 | | | Goldman Sachs | (6.558) |
| | | | | | | HSBC | 39.824 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|----------------------------------|---|---|-------------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.565) | SoundThinking Inc | Morgan Stanley | 51 | (5.397) | SP Plus Corp | Morgan Stanley | 1.079 |
| 1.421 | South Plains Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.132 | 10.517 | SpartanNash Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.113) |
| 55.658 | South Plains Financial Inc | Barclays Bank | 28.942 | 23.988 | SpartanNash Co | Barclays Bank | (19.670) |
| 4.077 | South Plains Financial Inc | Goldman Sachs | 6.116 | 11.310 | SpartanNash Co | Goldman Sachs | (1.143) |
| 6.383 | South Plains Financial Inc | HSBC | 10.404 | 10.459 | SpartanNash Co | HSBC | (6.275) |
| 18.263 | South Plains Financial Inc | Morgan Stanley | 9.497 | 2.630 | SpartanNash Co | Morgan Stanley | (2.157) |
| (24.859) | Southern Co | Bank of America Merrill Lynch | 70.863 | (7.623) | Spectrum Brands Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6.632 |
| (74.623) | Southern Co | Barclays Bank | 106.711 | (12.282) | Spectrum Brands Holdings Inc | Barclays Bank | 4.667 |
| (34.151) | Southern Co | Goldman Sachs | 99.037 | (1.410) | Spectrum Brands Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.227 |
| (172.190) | Southern Co | HSBC | 869.559 | (4.807) | Spectrum Brands Holdings Inc | HSBC | 5.384 |
| (20.192) | Southern Co | Morgan Stanley | 28.875 | (4.999) | Spectrum Brands Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.900 |
| (2.220) | Southern Copper Corp | Goldman Sachs | 14.008 | (6.026) | Sphere Entertainment Co | Barclays Bank | 5.182 |
| 1.033 | Southern Copper Corp | Morgan Stanley | (1.073) | (2.380) | Sphere Entertainment Co | Goldman Sachs | (4.546) |
| 2.662 | Southern First Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.822 | (1.704) | Sphere Entertainment Co | HSBC | 12.524 |
| 14.925 | Southern First Bancshares Inc | Barclays Bank | 766 | (130.025) | Spire Global Inc | Morgan Stanley | (3.927) |
| 18.078 | Southern First Bancshares Inc | Goldman Sachs | 17.277 | 14.392 | Spire Inc | Bank of America Merrill Lynch | (45.047) |
| 3.514 | Southern First Bancshares Inc | HSBC | 5.412 | 46.945 | Spire Inc | Barclays Bank | (140.365) |
| 11.120 | Southern First Bancshares Inc | Morgan Stanley | 568 | 27.679 | Spire Inc | Goldman Sachs | (86.156) |
| 8.896 | Southern Missouri Bancorp Inc | Barclays Bank | 2.491 | 32.183 | Spire Inc | HSBC | (106.427) |
| 5.702 | Southern Missouri Bancorp Inc | Goldman Sachs | 25.146 | 18.825 | Spire Inc | Morgan Stanley | (50.163) |
| 485 | Southern Missouri Bancorp Inc | HSBC | 2.318 | (16.441) | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 15.126 |
| (7.545) | Southern States Bancshares Inc | Goldman Sachs | 151 | (17.317) | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (26.668) |
| (8.868) | Southside Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (266) | (106.049) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Barclays Bank | 34.996 |
| (7.565) | Southside Bancshares Inc | Barclays Bank | 7.792 | (23.205) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (9.050) |
| (25.236) | Southside Bancshares Inc | Goldman Sachs | (757) | (11.554) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | HSBC | 1.271 |
| (10.835) | Southside Bancshares Inc | HSBC | 4.767 | (9.024) | Spirit Realty Capital Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.123 |
| (8.933) | Southside Bancshares Inc | Morgan Stanley | 9.201 | 3.883 | Splunk Inc | Bank of America Merrill Lynch | 39.956 |
| (3.580) | SouthState Corp | Bank of America Merrill Lynch | (4.291) | 10.811 | Splunk Inc | Barclays Bank | 9.946 |
| (63.814) | SouthState Corp | Barclays Bank | 86.243 | 11.522 | Splunk Inc | HSBC | 152.551 |
| (18.797) | SouthState Corp | HSBC | (5.308) | 2.877 | Splunk Inc | Morgan Stanley | 2.647 |
| (17.916) | SouthState Corp | Morgan Stanley | 24.758 | (13.439) | Spok Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 19.621 |
| (1.652) | Southwest Airlines Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.404) | (5.817) | Spok Holdings Inc | Barclays Bank | 9.016 |
| (2.376) | Southwest Airlines Co | Barclays Bank | (1.378) | (13.359) | Spok Holdings Inc | Morgan Stanley | 20.706 |
| (11.376) | Southwest Airlines Co | Morgan Stanley | (6.598) | 16.473 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (24.710) |
| (11.348) | Southwest Gas Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (21.709) | 18.215 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | Barclays Bank | (20.947) |
| (20.688) | Southwest Gas Holdings Inc | Barclays Bank | (18.387) | 21.114 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | HSBC | (30.404) |
| (8.901) | Southwest Gas Holdings Inc | Goldman Sachs | (27.504) | 1.979 | Spotify Technology SA | Bank of America Merrill Lynch | 7.193 |
| (4.504) | Southwest Gas Holdings Inc | HSBC | (9.511) | 3.225 | Spotify Technology SA | Barclays Bank | (1.613) |
| (13.854) | Southwest Gas Holdings Inc | Morgan Stanley | (10.146) | 1.312 | Spotify Technology SA | Goldman Sachs | 5.091 |
| 28.350 | Southwestern Energy Co | Bank of America Merrill Lynch | (11.057) | 1.560 | Spotify Technology SA | HSBC | 2.862 |
| 20.944 | Southwestern Energy Co | Barclays Bank | (10.472) | 378 | Spotify Technology SA | Morgan Stanley | (189) |
| 8.714 | Southwestern Energy Co | HSBC | 87 | (6.279) | SpringWorks Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (1.300) |
| 21.287 | Southwestern Energy Co | Morgan Stanley | (10.644) | 2.075 | Sprout Social Inc 'A' | Barclays Bank | (6.152) |
| 2.296 | Sovos Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 115 | 6.010 | Sprout Social Inc 'A' | HSBC | 17.459 |
| 29.424 | Sovos Brands Inc | Barclays Bank | 37.663 | 1.843 | Sprout Social Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.464) |
| 20.057 | Sovos Brands Inc | Goldman Sachs | 1.003 | (6.072) | Sprouts Farmers Market Inc | Barclays Bank | 4.615 |
| 12.467 | Sovos Brands Inc | HSBC | 3.300 | (2.302) | Sprouts Farmers Market Inc | HSBC | 1.611 |
| 24.253 | Sovos Brands Inc | Morgan Stanley | 30.803 | (1.598) | SPS Commerce Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.499) |
| (14.626) | SP Plus Corp | Bank of America Merrill Lynch | (15.942) | (2.770) | SPS Commerce Inc | Barclays Bank | 14.072 |
| (8.000) | SP Plus Corp | Barclays Bank | 1.600 | | | | |
| (10.418) | SP Plus Corp | Goldman Sachs | (11.356) | | | | |
| (5.720) | SP Plus Corp | HSBC | (13.099) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.533) | SPS Commerce Inc | Goldman Sachs | (7.737) | 5.239 | StarTek Inc | Bank of America | |
| (4.130) | SPS Commerce Inc | HSBC | (20.774) | | | Merrill Lynch | (1.257) |
| (927) | SPS Commerce Inc | Morgan Stanley | 4.709 | 12.530 | StarTek Inc | Barclays Bank | (752) |
| 20.999 | SPX Technologies Inc | Barclays Bank | (32.443) | 10.982 | StarTek Inc | Goldman Sachs | (2.636) |
| 2.165 | SPX Technologies Inc | HSBC | 10.078 | 1.797 | StarTek Inc | HSBC | (270) |
| 1.868 | Squarespace Inc 'A' | Bank of America | | 3.253 | StarTek Inc | Morgan Stanley | (195) |
| | | Merrill Lynch | 1.793 | (34.481) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| 9.016 | Squarespace Inc 'A' | Barclays Bank | (3.697) | | | Merrill Lynch | (34.825) |
| 1.794 | SQZ Biotechnologies Co | Barclays Bank | 4 | (104.364) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Barclays Bank | (18.795) |
| 14.396 | SQZ Biotechnologies Co | Goldman Sachs | (1.015) | (66.023) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (66.683) |
| (79.953) | SS&C Technologies Holdings Inc | Barclays Bank | 156.769 | (60.244) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | HSBC | (48.195) |
| (40.488) | SS&C Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | 45.347 | (91.943) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (15.631) |
| (61.104) | SS&C Technologies Holdings Inc | HSBC | 99.599 | (5.926) | State Street Corp | Bank of America | |
| (55.480) | SS&C Technologies Holdings Inc | Morgan Stanley | 108.098 | (3.108) | State Street Corp | Merrill Lynch | (2.844) |
| 220 | SSR Mining Inc | Barclays Bank | (297) | (12.850) | State Street Corp | Barclays Bank | 62 |
| 38.632 | SSR Mining Inc | Goldman Sachs | (75.332) | (9.471) | State Street Corp | Goldman Sachs | (6.168) |
| 7.636 | SSR Mining Inc | HSBC | (19.396) | (9.696) | State Street Corp | HSBC | 287 |
| 27.380 | SSR Mining Inc | Morgan Stanley | (36.963) | 2.228 | Steel Dynamics Inc | Morgan Stanley | 194 |
| (16.081) | St Joe Co | Barclays Bank | (19.297) | | | Bank of America | |
| (22.284) | St Joe Co | Goldman Sachs | (85.125) | 1.325 | Steel Dynamics Inc | Merrill Lynch | (10.359) |
| (8.137) | St Joe Co | HSBC | (38.488) | (3.355) | Steel Dynamics Inc | Barclays Bank | (6.250) |
| 1.603 | STAAR Surgical Co | Bank of America | | 8.206 | Steel Dynamics Inc | Barclays Bank | 20.331 |
| | | Merrill Lynch | (7.452) | 8.175 | Steel Dynamics Inc | HSBC | (51.333) |
| (2.837) | STAAR Surgical Co | Barclays Bank | 18.497 | 25.599 | Steelcase Inc 'A' | Morgan Stanley | (47.184) |
| 606 | STAAR Surgical Co | Goldman Sachs | (59) | | | Bank of America | |
| (906) | STAAR Surgical Co | HSBC | 8.806 | 27.193 | Steelcase Inc 'A' | Merrill Lynch | (13.781) |
| 2.768 | STAAR Surgical Co | Morgan Stanley | (16.619) | 23.743 | Steelcase Inc 'A' | Barclays Bank | (9.789) |
| (56.817) | STAG Industrial Inc (REIT) | Bank of America | | 29.131 | Steelcase Inc 'A' | Goldman Sachs | (12.538) |
| | | Merrill Lynch | 9.659 | 17.573 | Steelcase Inc 'A' | HSBC | (38.161) |
| (155.569) | STAG Industrial Inc (REIT) | Barclays Bank | (7.779) | (29.444) | Stellar Bancorp Inc | Morgan Stanley | (6.247) |
| (33.828) | STAG Industrial Inc (REIT) | Goldman Sachs | 5.751 | (5.997) | Stellar Bancorp Inc | Barclays Bank | 28.266 |
| (88.136) | STAG Industrial Inc (REIT) | HSBC | 58.337 | (2.361) | Stellar Bancorp Inc | Goldman Sachs | (6.597) |
| (18.793) | STAG Industrial Inc (REIT) | Morgan Stanley | (940) | (1.378) | Stellar Bancorp Inc | HSBC | (2.337) |
| (6.649) | Stagwell Inc | Bank of America | | (40.865) | Stem Inc | Morgan Stanley | 1.323 |
| | | Merrill Lynch | (4.654) | | | Bank of America | |
| (9.380) | Stagwell Inc | Barclays Bank | (469) | (66.265) | Stem Inc | Merrill Lynch | (31.466) |
| (5.930) | Stagwell Inc | HSBC | (2.609) | (55.153) | Stem Inc | Barclays Bank | (62.952) |
| (9.174) | Stagwell Inc | Morgan Stanley | (459) | (12.698) | Stem Inc | Goldman Sachs | (42.468) |
| 12.578 | Standard Motor Products Inc | Bank of America | | (18.128) | Stem Inc | HSBC | (14.222) |
| | | Merrill Lynch | (10.062) | 8.997 | Stepan Co | Morgan Stanley | (17.222) |
| 4.501 | Standard Motor Products Inc | Barclays Bank | (9.497) | 15.146 | StepStone Group Inc 'A' | Barclays Bank | (6.028) |
| 15.439 | Standard Motor Products Inc | Goldman Sachs | (12.688) | | | Bank of America | |
| 1.097 | Standard Motor Products Inc | HSBC | (1.528) | 10.346 | StepStone Group Inc 'A' | Merrill Lynch | (9.088) |
| 10.053 | Standard Motor Products Inc | Morgan Stanley | (21.212) | 25.404 | StepStone Group Inc 'A' | Barclays Bank | (12.208) |
| (2.518) | Standex International Corp | Barclays Bank | 8.763 | 17.443 | StepStone Group Inc 'A' | HSBC | (11.432) |
| (2.248) | Standex International Corp | Goldman Sachs | (3.642) | (2.780) | Stericycle Inc | Morgan Stanley | (20.583) |
| (7.404) | Standex International Corp | HSBC | (39.611) | | | Bank of America | |
| (10.305) | Stanley Black & Decker Inc | Bank of America | | (31.211) | Stericycle Inc | Merrill Lynch | 2.599 |
| | | Merrill Lynch | 24.011 | 804 | Stericycle Inc | Barclays Bank | 30.431 |
| (17.219) | Stanley Black & Decker Inc | Goldman Sachs | 40.120 | (22.943) | Stericycle Inc | Barclays Bank | (784) |
| (13.165) | Stanley Black & Decker Inc | Morgan Stanley | 65.693 | 519 | Stericycle Inc | Goldman Sachs | 21.452 |
| (3.549) | Star Group LP | Bank of America | | 145 | STERIS Plc | Morgan Stanley | (506) |
| | | Merrill Lynch | 603 | | | Bank of America | |
| (5.352) | Star Group LP | Barclays Bank | 428 | (4.995) | STERIS Plc | Merrill Lynch | (1.879) |
| (6.380) | Star Group LP | Goldman Sachs | 1.085 | (1.855) | STERIS Plc | Barclays Bank | 45.205 |
| (2.325) | Star Group LP | HSBC | 1.465 | (904) | STERIS Plc | Goldman Sachs | 24.041 |
| (30.215) | Star Group LP | Morgan Stanley | 2.417 | (39.980) | Sterling Bancorp Inc | HSBC | (8.037) |
| (9.120) | Star Holdings | Barclays Bank | 5.290 | | | Bank of America | |
| (9.099) | Star Holdings | HSBC | 7.825 | (32.716) | Sterling Bancorp Inc | Merrill Lynch | (12.394) |
| 2.183 | Starbucks Corp | Goldman Sachs | (5.067) | (52.065) | Sterling Bancorp Inc | Barclays Bank | 4.580 |
| 6.215 | Starbucks Corp | HSBC | (15.406) | (17.925) | Sterling Bancorp Inc | Goldman Sachs | (16.140) |
| | | | | (37.456) | Sterling Bancorp Inc | HSBC | (5.557) |
| | | | | (14.992) | Sterling Check Corp | Morgan Stanley | 5.244 |
| | | | | (3.738) | Sterling Check Corp | Barclays Bank | (3.748) |
| | | | | | | Morgan Stanley | (935) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 16.460 | Sterling Infrastructure Inc | Barclays Bank | 46.911 | 954 | Stryker Corp | Barclays Bank | (15.493) |
| 13.356 | Sterling Infrastructure Inc | Goldman Sachs | 53.424 | 2.382 | Stryker Corp | Goldman Sachs | (43.397) |
| (4.133) | Steven Madden Ltd | Bank of America | | 1.504 | Stryker Corp | HSBC | (8.155) |
| | | Merrill Lynch | 6.447 | 2.824 | Stryker Corp | Morgan Stanley | (9.673) |
| (2.724) | Steven Madden Ltd | Barclays Bank | 54 | 5.359 | Summit Financial Group Inc | Bank of America | |
| (35.195) | Steven Madden Ltd | HSBC | 57.368 | | | Merrill Lynch | 8.574 |
| (1.583) | Stewart Information Services Corp | Bank of America | | 16.443 | Summit Financial Group Inc | Barclays Bank | (658) |
| | | Merrill Lynch | (1.980) | 16.096 | Summit Financial Group Inc | Goldman Sachs | 25.754 |
| (1.956) | Stewart Information Services Corp | Barclays Bank | | 10.573 | Summit Financial Group Inc | HSBC | 18.291 |
| (1.542) | Stewart Information Services Corp | HSBC | (5.107) | 14.176 | Summit Financial Group Inc | Morgan Stanley | (567) |
| (2.488) | Stewart Information Services Corp | Morgan Stanley | (6.344) | 66.772 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| 9.352 | Stifel Financial Corp | Barclays Bank | (28.430) | 37.121 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | (20.850) |
| 5.849 | Stifel Financial Corp | Goldman Sachs | (7.194) | 30.210 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (7.162) |
| 17.449 | Stifel Financial Corp | HSBC | (24.603) | 25.627 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (10.271) |
| 47.532 | Stitch Fix Inc 'A' | Bank of America | | 17.091 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | HSBC | (6.753) |
| | | Merrill Lynch | 29.945 | 3.217 | Summit Materials Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.589) |
| 41.207 | Stitch Fix Inc 'A' | Barclays Bank | 16.895 | | | Bank of America | |
| 25.722 | Stitch Fix Inc 'A' | Goldman Sachs | 16.205 | 14.951 | Summit Materials Inc 'A' | Merrill Lynch | (2.252) |
| 29.546 | Stitch Fix Inc 'A' | HSBC | 16.546 | 16.377 | Summit Materials Inc 'A' | Barclays Bank | (13.423) |
| 13.958 | Stitch Fix Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.723 | 15.435 | Summit Materials Inc 'A' | Goldman Sachs | (11.464) |
| (11.536) | Stock Yards Bancorp Inc | Barclays Bank | 9.921 | 10.433 | Summit Materials Inc 'A' | HSBC | 12.833 |
| (13.181) | Stock Yards Bancorp Inc | Goldman Sachs | (12.390) | 2.280 | Sun Communities Inc (REIT) | Morgan Stanley | (9.807) |
| (12.399) | Stock Yards Bancorp Inc | HSBC | 14.507 | 4.478 | Sun Communities Inc (REIT) | Bank of America | |
| 9.933 | Stoke Therapeutics Inc | Barclays Bank | (5.364) | | | Merrill Lynch | (17.009) |
| 4.293 | Stoke Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (4.207) | 2.481 | Sun Communities Inc (REIT) | Barclays Bank | (17.196) |
| 4.757 | Stoke Therapeutics Inc | HSBC | (6.089) | 171 | Sun Communities Inc (REIT) | Goldman Sachs | (18.508) |
| 28.596 | StoneCo Ltd 'A' | Barclays Bank | (38.318) | (4.876) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Morgan Stanley | (657) |
| 33.416 | StoneCo Ltd 'A' | Goldman Sachs | (55.136) | (9.704) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Barclays Bank | (6.412) |
| 33.538 | StoneCo Ltd 'A' | HSBC | (45.612) | 35.171 | SunCoke Energy Inc | Goldman Sachs | (6.259) |
| 3.891 | StoneCo Ltd 'A' | Morgan Stanley | (5.214) | 41.420 | SunCoke Energy Inc | Barclays Bank | (27.082) |
| 895 | Stoneridge Inc | Bank of America | | (149.167) | Sunlight Financial Holdings Inc | HSBC | (40.177) |
| | | Merrill Lynch | 1.307 | (15.595) | Sunlight Financial Holdings Inc | Barclays Bank | 7.563 |
| 5.306 | Stoneridge Inc | Barclays Bank | 637 | (16.260) | Sunlight Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 33 |
| 9.942 | Stoneridge Inc | Goldman Sachs | 14.515 | 21.692 | Sunnova Energy International Inc | HSBC | 45.987 |
| 6.977 | Stoneridge Inc | HSBC | (70) | 14.384 | SunOpta Inc | Bank of America | |
| 5.182 | Stoneridge Inc | Morgan Stanley | 622 | 21.935 | SunOpta Inc | Merrill Lynch | (14.384) |
| (1.654) | StoneX Group Inc | Bank of America | | 18.157 | SunOpta Inc | Barclays Bank | (16.671) |
| | | Merrill Lynch | 5.893 | 29.669 | SunOpta Inc | Goldman Sachs | (18.157) |
| (1.041) | StoneX Group Inc | Barclays Bank | 2.843 | 30.204 | SunOpta Inc | HSBC | (40.103) |
| (4.382) | StoneX Group Inc | HSBC | 23.380 | (14.826) | SunPower Corp | Morgan Stanley | (22.955) |
| (1.134) | StoneX Group Inc | Morgan Stanley | 4.479 | 1.135 | SunPower Corp | Bank of America | |
| (2.996) | Strategic Education Inc | Barclays Bank | 3.415 | | | Merrill Lynch | 2.965 |
| (2.207) | Strategic Education Inc | Goldman Sachs | 5.915 | (7.661) | SunPower Corp | Bank of America | |
| (853) | Strategic Education Inc | HSBC | 4.299 | 17.482 | SunPower Corp | Merrill Lynch | (227) |
| 620 | Strattec Security Corp | Bank of America | | (7.765) | SunPower Corp | Barclays Bank | (4.060) |
| | | Merrill Lynch | 657 | (4.612) | SunPower Corp | Barclays Bank | 9.265 |
| 1.531 | Strattec Security Corp | Barclays Bank | (1.975) | 12.709 | SunPower Corp | Goldman Sachs | 1.553 |
| 2.204 | Strattec Security Corp | HSBC | (551) | 3.585 | Sunrun Inc | Morgan Stanley | (2.444) |
| (20.817) | Stratus Properties Inc | Bank of America | | 3.275 | Sunrun Inc | Morgan Stanley | 6.736 |
| | | Merrill Lynch | (23.107) | (37.332) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | 6.447 |
| (6.172) | Stratus Properties Inc | Goldman Sachs | (6.851) | | | HSBC | 1.474 |
| (5.636) | Stratus Properties Inc | Morgan Stanley | (8.003) | (35.372) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | Barclays Bank | 13.440 |
| (3.125) | Stride Inc | Bank of America | | | | Goldman Sachs | 9.550 |
| | | Merrill Lynch | 5.750 | | | | |
| (4.824) | Stride Inc | Morgan Stanley | 6.078 | | | | |
| 7.001 | Stronghold Digital Mining Inc 'A' | Barclays Bank | (1.890) | | | | |
| 842 | Structure Therapeutics Inc ADR | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 4.769 | | | | |
| 832 | Structure Therapeutics Inc ADR | Barclays Bank | 6.398 | | | | |
| 1.487 | Structure Therapeutics Inc ADR | Goldman Sachs | 10.306 | | | | |
| 780 | Structure Therapeutics Inc ADR | HSBC | 6.312 | | | | |
| 2.740 | Stryker Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (32.644) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (52.658) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | HSBC | 19.483 | 9.713 | Synchrony Financial | Bank of America Merrill Lynch | 26.582 |
| 219 | Super Micro Computer Inc | Barclays Bank | 12.958 | 31.707 | Synchrony Financial | Barclays Bank | 23.463 |
| (1.423) | Super Micro Computer Inc | Goldman Sachs | (122.577) | 33.714 | Synchrony Financial | Goldman Sachs | 105.188 |
| 305 | Super Micro Computer Inc | HSBC | (3.087) | 11.505 | Synchrony Financial | HSBC | 42.560 |
| 498 | Super Micro Computer Inc | Morgan Stanley | 2.390 | 11.740 | Synchrony Financial | Morgan Stanley | 8.688 |
| (518) | Super Micro Computer Inc | Morgan Stanley | (30.650) | (7.818) | Syndax Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 17.669 |
| (6.506) | Superior Group of Cos Inc | Barclays Bank | 2.407 | (11.916) | Syndax Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 13.703 |
| (3.423) | Superior Group of Cos Inc | Goldman Sachs | (685) | (10.234) | Synlogic Inc | Goldman Sachs | (27) |
| (3.069) | Superior Group of Cos Inc | HSBC | (4.266) | (31.575) | Synlogic Inc | HSBC | 231 |
| (3.498) | Superior Group of Cos Inc | Morgan Stanley | 1.294 | 1.581 | Synopsys Inc | Bank of America Merrill Lynch | 137.515 |
| (22.177) | Superior Industries International Inc | Barclays Bank | 2.218 | 1.954 | Synopsys Inc | Barclays Bank | 114.465 |
| (18.008) | Superior Industries International Inc | Morgan Stanley | 1.801 | 2.626 | Synopsys Inc | Goldman Sachs | 228.409 |
| 849 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (991) | 493 | Synopsys Inc | HSBC | 43.640 |
| 19.801 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (22.573) | 1.194 | Synopsys Inc | Morgan Stanley | 69.945 |
| 9.332 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (10.875) | 3.372 | Synovus Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.744) |
| 18.582 | Supernus Pharmaceuticals Inc | HSBC | (51.006) | 19.920 | Synovus Financial Corp | Barclays Bank | (11.112) |
| 5.253 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (5.000) | 6.356 | Synovus Financial Corp | Goldman Sachs | (2.793) |
| 29.251 | Surface Oncology Inc | Barclays Bank | (878) | 4.602 | Sysco Corp | Morgan Stanley | (2.841) |
| 20.756 | Surface Oncology Inc | Goldman Sachs | 4.458 | (12.827) | Sysco Corp | Bank of America Merrill Lynch | 59.902 |
| 5.112 | Surface Oncology Inc | Morgan Stanley | (153) | (897) | Sysco Corp | Barclays Bank | 1.812 |
| (14.751) | Surgery Partners Inc | Bank of America Merrill Lynch | 590 | (3.130) | Sysco Corp | Goldman Sachs | 14.617 |
| 1.738 | Surgery Partners Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.473) | (9.853) | Sysco Corp | HSBC | 62.074 |
| (673) | Surgery Partners Inc | HSBC | (680) | (9.383) | Sysco Corp | Morgan Stanley | 18.954 |
| (6.917) | Surgery Partners Inc | Morgan Stanley | 14.664 | (1.853) | T Rowe Price Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.502) |
| 978 | Surgery Partners Inc | Morgan Stanley | (2.073) | (4.343) | T Rowe Price Group Inc | Barclays Bank | (5.820) |
| (1.795) | Surmodics Inc | Barclays Bank | (233) | (728) | T Rowe Price Group Inc | HSBC | (1.340) |
| (3.523) | Surmodics Inc | Goldman Sachs | 2.501 | (4.396) | T Rowe Price Group Inc | Morgan Stanley | (5.890) |
| (6.547) | Surmodics Inc | HSBC | 15.975 | 14.198 | Tabula Rasa HealthCare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.661) |
| 16.728 | Sutro Biopharma Inc | Bank of America Merrill Lynch | (22.917) | 4.995 | Tabula Rasa HealthCare Inc | Goldman Sachs | (3.047) |
| 25.530 | Sutro Biopharma Inc | Barclays Bank | (20.424) | 16.587 | Tactile Systems Technology Inc | Barclays Bank | (20.734) |
| 21.861 | Sutro Biopharma Inc | Goldman Sachs | (29.950) | (5.050) | Take-Two Interactive Software Inc | Barclays Bank | (2.525) |
| 16.381 | Sutro Biopharma Inc | HSBC | (16.053) | (8.535) | Take-Two Interactive Software Inc | Goldman Sachs | (108.224) |
| 29.519 | Sutro Biopharma Inc | Morgan Stanley | (23.615) | (13.209) | Take-Two Interactive Software Inc | HSBC | (159.301) |
| (1.959) | Sweetgreen Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 196 | 4.049 | Talaris Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (162) |
| (6.566) | Sweetgreen Inc 'A' | Barclays Bank | 1.445 | 7.045 | Talaris Therapeutics Inc | Barclays Bank | (1.339) |
| (15.329) | Sweetgreen Inc 'A' | HSBC | (3.372) | 8.574 | Talaris Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (343) |
| (26.876) | Sweetgreen Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.913 | 4.562 | Talaris Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (867) |
| (4.220) | SWK Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.477) | (2.170) | Talis Biomedical Corp | Barclays Bank | (85) |
| (11.534) | SWK Holdings Corp | Barclays Bank | 5.882 | (23.032) | Talos Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.453) |
| (8.304) | SWK Holdings Corp | Goldman Sachs | (2.906) | (5.534) | Talos Energy Inc | Barclays Bank | 3.055 |
| (3.590) | SWK Holdings Corp | Morgan Stanley | 1.831 | (13.171) | Talos Energy Inc | Morgan Stanley | 3.293 |
| (1.769) | Sylvamo Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.450 | 7.723 | Tandem Diabetes Care Inc | Barclays Bank | (25.331) |
| (7.048) | Sylvamo Corp | Barclays Bank | 6.484 | 1.845 | Tandem Diabetes Care Inc | HSBC | (13.062) |
| (7.099) | Sylvamo Corp | Goldman Sachs | 13.843 | 1.068 | Tandem Diabetes Care Inc | Morgan Stanley | (3.503) |
| (3.437) | Sylvamo Corp | HSBC | 17.549 | 3.398 | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 3.364 |
| (615) | Sylvamo Corp | Morgan Stanley | 566 | 23.634 | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Barclays Bank | 13.708 |
| 6.909 | Synaptics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 55.372 | 11.043 | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Goldman Sachs | 11.243 |
| 5.152 | Synaptics Inc | Barclays Bank | 19.784 | 11.270 | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | HSBC | 14.651 |
| 2.633 | Synaptics Inc | Goldman Sachs | 27.620 | 1.454 | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Morgan Stanley | 843 |
| 3.988 | Synaptics Inc | HSBC | 33.133 | (9.982) | Tango Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 11.080 |
| 10.940 | Synaptics Inc | Morgan Stanley | 51.277 | (1.958) | Tapestry Inc | Barclays Bank | 5.600 |
| 7.330 | Synchronoss Technologies Inc | Barclays Bank | 319 | | | | |
| 2.722 | Synchronoss Technologies Inc | Goldman Sachs | 155 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 8.443 | Tapestry Inc | Goldman Sachs | (31.492) | (6.207) | Tela Bio Inc | Barclays Bank | (2.979) |
| (1.156) | Tapestry Inc | Goldman Sachs | 4.253 | 15.093 | Teladoc Health Inc | Bank of America | |
| 21.780 | Tapestry Inc | HSBC | 18.949 | | | Merrill Lynch | (21.994) |
| (5.981) | Tapestry Inc | HSBC | 16.547 | 69.458 | Teladoc Health Inc | Barclays Bank | (136.832) |
| 2.623 | Targa Resources Corp | Bank of America | | 31.630 | Teladoc Health Inc | Goldman Sachs | (64.682) |
| | | Merrill Lynch | (7.817) | 41.027 | Teladoc Health Inc | HSBC | (128.096) |
| 7.286 | Targa Resources Corp | Barclays Bank | (20.041) | 19.363 | Teladoc Health Inc | Morgan Stanley | (36.493) |
| 14.475 | Targa Resources Corp | Goldman Sachs | (43.136) | 357 | Teledyne Technologies Inc | Bank of America | |
| 15.124 | Targa Resources Corp | HSBC | (49.071) | | | Merrill Lynch | (10.494) |
| 19.928 | Targa Resources Corp | Morgan Stanley | (62.807) | (4.408) | Teledyne Technologies Inc | Barclays Bank | 129.463 |
| 3.460 | Target Corp | Bank of America | | 1.141 | Teledyne Technologies Inc | Barclays Bank | (11.952) |
| | | Merrill Lynch | (62.374) | (1.524) | Teledyne Technologies Inc | Goldman Sachs | 35.250 |
| 825 | Target Corp | Barclays Bank | (14.867) | 378 | Teledyne Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.883) |
| 2.424 | Target Corp | Goldman Sachs | (59.891) | (1.565) | Teledyne Technologies Inc | HSBC | 34.289 |
| 1.824 | Target Corp | HSBC | (12.525) | 1.058 | Teledyne Technologies Inc | HSBC | (4.258) |
| 1.900 | Target Corp | Morgan Stanley | (17.512) | (3.668) | Teleflex Inc | Bank of America | |
| (10.190) | Target Hospitality Corp | Barclays Bank | 15.744 | | | Merrill Lynch | 60.229 |
| 9.802 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (7.593) | Teleflex Inc | Barclays Bank | 102.126 |
| | | Merrill Lynch | (5.979) | (3.822) | Teleflex Inc | Goldman Sachs | 62.757 |
| 8.366 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (2.426) | (2.251) | Teleflex Inc | HSBC | 61.430 |
| 7.615 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (4.645) | (6.404) | Teleflex Inc | Morgan Stanley | 86.134 |
| 12.724 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | HSBC | 4.581 | 21.608 | Telephone and Data Systems Inc | Bank of America | |
| 10.099 | Tarsus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (2.929) | | | Merrill Lynch | (11.020) |
| 49.607 | Taylor Morrison Home Corp | Bank of America | | 48.687 | Telephone and Data Systems Inc | Barclays Bank | (33.594) |
| | | Merrill Lynch | (18.526) | | | | |
| 48.762 | Taylor Morrison Home Corp | Barclays Bank | 8.408 | 24.629 | Telephone and Data Systems Inc | Goldman Sachs | (12.561) |
| 40.880 | Taylor Morrison Home Corp | Goldman Sachs | (18.789) | 6.581 | Telephone and Data Systems Inc | HSBC | (4.409) |
| 27.436 | Taylor Morrison Home Corp | HSBC | 119.277 | 14.809 | Telephone and Data Systems Inc | Morgan Stanley | (10.218) |
| 22.597 | Taylor Morrison Home Corp | Morgan Stanley | 2.528 | | Telesat Corp | Barclays Bank | 1.877 |
| 6.314 | TCR2 Therapeutics Inc | Bank of America | | (4.692) | Telesat Corp | Goldman Sachs | 12.860 |
| | | Merrill Lynch | (2.305) | (9.526) | Telesat Corp | Morgan Stanley | 1.693 |
| 33.116 | TCR2 Therapeutics Inc | Barclays Bank | (7.782) | (4.232) | Telesat Corp | Barclays Bank | (194) |
| 9.957 | TCR2 Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (3.634) | 485 | Telesis Bio Inc | Morgan Stanley | (71) |
| 17.242 | TCR2 Therapeutics Inc | HSBC | (6.466) | 178 | Telesis Bio Inc | Bank of America | |
| 17.794 | TCR2 Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (4.182) | (7.906) | Tellurian Inc | Merrill Lynch | 1.186 |
| 4.908 | TD SYNEX Corp | Bank of America | | | | Barclays Bank | 35.926 |
| | | Merrill Lynch | 4.270 | (163.298) | Tellurian Inc | Goldman Sachs | 12.612 |
| 25.550 | TD SYNEX Corp | Barclays Bank | (39.858) | (84.082) | Tellurian Inc | Barclays Bank | (7.712) |
| 31.943 | TD SYNEX Corp | Goldman Sachs | 27.790 | (9.640) | Telos Corp | Bank of America | |
| 20.093 | TD SYNEX Corp | HSBC | 32.149 | (9.756) | Tempur Sealy International Inc | Merrill Lynch | 24.000 |
| 3.841 | TD SYNEX Corp | Morgan Stanley | (5.992) | | | | |
| 11.946 | TE Connectivity Ltd | Bank of America | | 1.106 | Tempur Sealy International Inc | Morgan Stanley | (1.405) |
| | | Merrill Lynch | 6.093 | 515 | Tenable Holdings Inc | Bank of America | |
| 8.068 | TE Connectivity Ltd | Barclays Bank | (17.024) | | | Merrill Lynch | 1.045 |
| 2.395 | TE Connectivity Ltd | Goldman Sachs | 1.221 | 25.562 | Tenable Holdings Inc | Barclays Bank | (5.624) |
| 6.420 | TE Connectivity Ltd | HSBC | 2.529 | 1.308 | Tenable Holdings Inc | HSBC | 4.434 |
| 14.753 | TE Connectivity Ltd | Morgan Stanley | (31.129) | 3.784 | Tempur Sealy International Inc | Barclays Bank | (4.806) |
| (2.351) | Team Inc | Barclays Bank | (7.688) | (11.835) | Tempur Sealy International Inc | Goldman Sachs | 29.114 |
| (2.886) | Team Inc | Goldman Sachs | (9.582) | (11.068) | Tempur Sealy International Inc | HSBC | 10.293 |
| (785) | Team Inc | HSBC | (2.143) | 1.106 | Tempur Sealy International Inc | Morgan Stanley | (1.405) |
| (2.342) | Team Inc | Morgan Stanley | (7.658) | | Tenaya Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 1 | Technip Energies NV ADR | Morgan Stanley | (1) | | | Merrill Lynch | (260) |
| (2.250) | TechTarget Inc | Bank of America | | (3.578) | Tenaya Therapeutics Inc | Barclays Bank | 1.145 |
| | | Merrill Lynch | (8.955) | (2.675) | Tenaya Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 856 |
| (6.353) | TechTarget Inc | Barclays Bank | (14.104) | 521 | Tenet Healthcare Corp | Bank of America | |
| (7.008) | TechTarget Inc | Goldman Sachs | (27.051) | | | Merrill Lynch | (314) |
| (3.747) | TechTarget Inc | HSBC | (11.314) | (10.001) | Tenet Healthcare Corp | Barclays Bank | 30.704 |
| (1.123) | TechTarget Inc | Morgan Stanley | (2.493) | (3.872) | Tenet Healthcare Corp | Goldman Sachs | 5.692 |
| 10.978 | Teekay Corp | Goldman Sachs | (3.952) | 2.008 | Tennant Co | Bank of America | |
| 57.107 | Teekay Corp | Morgan Stanley | (29.125) | | | Merrill Lynch | (9.699) |
| 485 | Teekay Tankers Ltd 'A' | Bank of America | | 7.602 | Tennant Co | Barclays Bank | (38.238) |
| | | Merrill Lynch | (2.304) | 224 | Tennant Co | Goldman Sachs | (1.082) |
| 6.292 | Teekay Tankers Ltd 'A' | Goldman Sachs | (29.887) | | | | |
| 1.946 | Teekay Tankers Ltd 'A' | HSBC | (2.082) | | | | |
| 2.325 | TEGNA Inc | Goldman Sachs | (1.325) | | | | |
| (3.318) | Tejon Ranch Co | Barclays Bank | 630 | | | | |
| (41.454) | Tejon Ranch Co | Goldman Sachs | 3.731 | | | | |
| (11.144) | Tejon Ranch Co | HSBC | (1.114) | | | | |
| (13.890) | Tela Bio Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (8.473) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|---|-----------------|---|-----------|---|-----------------|---|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| 717 | Tennant Co | HSBC | (3.492) | (1.488) | TFF Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| 3.022 | Tennant Co | Morgan Stanley | (13.401) | | | Merrill Lynch | 270 |
| 4.003 | Teradata Corp | Bank of America | | (14.472) | TFF Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 2.088 |
| | | Merrill Lynch | 10.528 | 3.763 | TFS Financial Corp | Bank of America | |
| 36.147 | Teradata Corp | Barclays Bank | 61.088 | | | Merrill Lynch | 414 |
| 17.656 | Teradata Corp | HSBC | 53.498 | 1.967 | TFS Financial Corp | Barclays Bank | 39 |
| 9.203 | Teradata Corp | Morgan Stanley | 15.553 | (36.490) | TFS Financial Corp | Barclays Bank | (730) |
| 4.901 | Teradyne Inc | Barclays Bank | 20.004 | (149.014) | TFS Financial Corp | Goldman Sachs | (16.392) |
| 33.568 | Teradyne Inc | Goldman Sachs | 248.067 | 7.801 | TFS Financial Corp | Goldman Sachs | 858 |
| 12.687 | Teradyne Inc | HSBC | 129.281 | (156.045) | TFS Financial Corp | HSBC | 54.615 |
| 4.326 | Teradyne Inc | Morgan Stanley | 16.663 | 1.698 | TFS Financial Corp | HSBC | (594) |
| (9.914) | Terawulf Inc | Morgan Stanley | 1.091 | (11.519) | TFS Financial Corp | Morgan Stanley | (230) |
| 2.673 | Terex Corp | Bank of America | | 3.392 | TFS Financial Corp | Morgan Stanley | 68 |
| | | Merrill Lynch | (1.898) | (1.249) | TG Therapeutics Inc | Barclays Bank | 3.197 |
| 23.322 | Terex Corp | Barclays Bank | (41.280) | (14.929) | TG Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 76.586 |
| 830 | Terex Corp | Goldman Sachs | (589) | (6.304) | TG Therapeutics Inc | HSBC | 44.632 |
| 5.913 | Terex Corp | HSBC | (4.198) | (1.329) | TG Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 3.402 |
| 6.526 | Terex Corp | Morgan Stanley | (11.551) | (14.489) | Theravance Biopharma Inc | Barclays Bank | (724) |
| 5.724 | Terns Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (286) | (20.821) | Theravance Biopharma Inc | Goldman Sachs | 4.997 |
| 1.442 | Terreno Realty Corp (REIT) | Bank of America | | (1.785) | Theravance Biopharma Inc | Morgan Stanley | (89) |
| | | Merrill Lynch | 1.319 | (685) | Thermo Fisher Scientific Inc | Bank of America | |
| 58.779 | Terreno Realty Corp (REIT) | Barclays Bank | 7.054 | | | Merrill Lynch | 13.987 |
| 20.887 | Terreno Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (10.652) | (530) | Thermo Fisher Scientific Inc | Barclays Bank | 13.653 |
| 22.466 | Terreno Realty Corp (REIT) | HSBC | (11.020) | (562) | Thermo Fisher Scientific Inc | HSBC | 22.098 |
| 12.301 | Terreno Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | 1.476 | (770) | Thermo Fisher Scientific Inc | Morgan Stanley | 19.835 |
| 13.435 | Territorial Bancorp Inc | Barclays Bank | (7.792) | 8.665 | Thermon Group Holdings Inc | Bank of America | |
| 1.714 | Territorial Bancorp Inc | Goldman Sachs | 1.183 | | | Merrill Lynch | 14.211 |
| 2.890 | Territorial Bancorp Inc | HSBC | (751) | 15.126 | Thermon Group Holdings Inc | Barclays Bank | 7.866 |
| 12.249 | Territorial Bancorp Inc | Morgan Stanley | (7.104) | 7.947 | Thermon Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 13.033 |
| (458) | Tesla Inc | Bank of America | | 19.114 | Thermon Group Holdings Inc | HSBC | 34.214 |
| | | Merrill Lynch | (11.999) | 22.219 | Thermon Group Holdings Inc | Morgan Stanley | 11.554 |
| (932) | Tesla Inc | Barclays Bank | (10.420) | 4.340 | Theseus Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (12.434) |
| (5.506) | Tesla Inc | Goldman Sachs | (185.552) | 6.981 | Theseus Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (20.001) |
| (1.323) | Tesla Inc | HSBC | (37.388) | (10.493) | Third Coast Bancshares Inc | Barclays Bank | (210) |
| (2.533) | Tesla Inc | Morgan Stanley | (28.319) | 501 | Thor Industries Inc | Bank of America | |
| 15.793 | TESSCO Technologies Inc | Morgan Stanley | 2.053 | (4.116) | Thor Industries Inc | Merrill Lynch | (892) |
| 3.187 | Tetra Tech Inc | Barclays Bank | (22.023) | 1.404 | Thor Industries Inc | Barclays Bank | 13.459 |
| 10.813 | Tetra Tech Inc | Goldman Sachs | (84.234) | (5.849) | Thor Industries Inc | Goldman Sachs | 10.411 |
| (221) | Tetra Tech Inc | HSBC | 128 | (4.325) | Thor Industries Inc | HSBC | 21.106 |
| 5.066 | Tetra Tech Inc | HSBC | (22.898) | 434 | Thor Industries Inc | HSBC | (2.118) |
| 6.795 | Tetra Tech Inc | Morgan Stanley | (46.953) | (4.890) | Thor Industries Inc | Morgan Stanley | 15.990 |
| (44.191) | TETRA Technologies Inc | Barclays Bank | 14.141 | 6.592 | Thorne HealthTech Inc | Barclays Bank | (132) |
| (4.859) | Texas Capital Bancshares Inc | Barclays Bank | 14.917 | 9.605 | Thorne HealthTech Inc | Goldman Sachs | (2.209) |
| (7.708) | Texas Capital Bancshares Inc | Goldman Sachs | (23.355) | 8.728 | Thorne HealthTech Inc | HSBC | (175) |
| (7.520) | Texas Capital Bancshares Inc | HSBC | (11.130) | 6.558 | Thorne HealthTech Inc | Morgan Stanley | (131) |
| (12.448) | Texas Instruments Inc | Barclays Bank | (46.431) | (2.631) | Thoughtworks Holding Inc | Bank of America | |
| (4.698) | Texas Instruments Inc | Goldman Sachs | (43.832) | 3.246 | Thoughtworks Holding Inc | Bank of America | |
| (3.944) | Texas Instruments Inc | HSBC | (40.899) | 10.898 | Thoughtworks Holding Inc | Merrill Lynch | 747 |
| (3.711) | Texas Instruments Inc | Morgan Stanley | (13.842) | 8.461 | Thoughtworks Holding Inc | Barclays Bank | 1.090 |
| 243 | Texas Pacific Land Corp | Bank of America | | 5.906 | Thoughtworks Holding Inc | Goldman Sachs | 1.946 |
| | | Merrill Lynch | (18.123) | (13.594) | ThredUp Inc 'A' | HSBC | 3.485 |
| 189 | Texas Pacific Land Corp | Barclays Bank | (13.120) | (13.760) | ThredUp Inc 'A' | Goldman Sachs | 11.759 |
| 435 | Texas Pacific Land Corp | HSBC | (45.101) | (10.165) | ThredUp Inc 'A' | HSBC | 14.104 |
| 1.956 | Texas Roadhouse Inc | Bank of America | | 14.103 | Thryv Holdings Inc | Morgan Stanley | 7.675 |
| | | Merrill Lynch | (939) | 3.431 | Thryv Holdings Inc | Bank of America | |
| 7.418 | Texas Roadhouse Inc | Barclays Bank | (33.232) | 29.773 | Thryv Holdings Inc | Merrill Lynch | 21.578 |
| 9.918 | Texas Roadhouse Inc | HSBC | (7.282) | 23.415 | Thryv Holdings Inc | Barclays Bank | (2.024) |
| 12.757 | Texas Roadhouse Inc | Morgan Stanley | (57.151) | 18.448 | Thryv Holdings Inc | Goldman Sachs | 45.553 |
| (32.838) | Textainer Group Holdings Ltd | Barclays Bank | 19.703 | (7.354) | Thryv Holdings Inc | HSBC | 58.069 |
| (41.637) | Textainer Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | — | (3.854) | Tidewater Inc | Morgan Stanley | (10.884) |
| (16.121) | Textainer Group Holdings Ltd | HSBC | (16.121) | | | Barclays Bank | 21.841 |
| (1.181) | Textainer Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | 709 | | | Goldman Sachs | (886) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|----------------------------------|---|---|---------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (5.020) | Tidewater Inc | HSBC | (10.743) | 2.497 | TopBuild Corp | Goldman Sachs | (22.448) |
| 5.026 | Tile Shop Holdings Inc | Barclays Bank | 251 | 4.309 | TopBuild Corp | HSBC | (38.221) |
| 8.210 | Tile Shop Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.859 | 3.491 | TopBuild Corp | Morgan Stanley | (14.837) |
| (21.039) | Tilly's Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.894 | 4.942 | Topgolf Callaway Brands Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.633) |
| (14.565) | Tilly's Inc | Barclays Bank | (8.011) | 107.212 | Topgolf Callaway Brands Corp | Barclays Bank | 106.676 |
| (31.050) | Tilly's Inc | Goldman Sachs | 2.795 | 12.167 | Topgolf Callaway Brands Corp | Goldman Sachs | (8.942) |
| (27.775) | Tilly's Inc | HSBC | (3.889) | 14.333 | Topgolf Callaway Brands Corp | HSBC | (55.041) |
| (26.557) | Tilly's Inc | Morgan Stanley | (14.606) | 21.855 | Topgolf Callaway Brands Corp | Morgan Stanley | 21.746 |
| 8.240 | Timberland Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.214 | (18.709) | Toro Co | Bank of America Merrill Lynch | 122.505 |
| 8.978 | Timberland Bancorp Inc | Barclays Bank | 2.440 | (19.087) | Toro Co | Barclays Bank | 131.412 |
| 3.688 | Timberland Bancorp Inc | Goldman Sachs | 2.424 | (11.687) | Toro Co | Goldman Sachs | 126.165 |
| 9.443 | Timberland Bancorp Inc | HSBC | 8.531 | (26.585) | Toro Co | HSBC | 76.425 |
| 5.206 | Timberland Bancorp Inc | Morgan Stanley | 1.340 | 1.581 | Towne Bank | Morgan Stanley | 185.298 |
| 2.061 | Timken Co | Bank of America Merrill Lynch | (3.359) | 37.672 | Towne Bank | Bank of America Merrill Lynch | 2.751 |
| 31.727 | Timken Co | Barclays Bank | (73.289) | 17.329 | Towne Bank | Barclays Bank | 1.884 |
| 31.684 | Timken Co | Goldman Sachs | (51.645) | 3.155 | Towne Bank | Goldman Sachs | 30.152 |
| 20.997 | Timken Co | HSBC | (66.560) | 21.283 | Townsquare Media Inc 'A' | Morgan Stanley | 158 |
| 2.589 | Timken Co | Morgan Stanley | (5.981) | 10.577 | Townsquare Media Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (3.192) |
| (12.911) | TimkenSteel Corp | Bank of America Merrill Lynch | 129 | 31.746 | Townsquare Media Inc 'A' | Barclays Bank | 1.163 |
| (13.785) | TimkenSteel Corp | Barclays Bank | 13.647 | 5.325 | Townsquare Media Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.762) |
| (18.822) | TimkenSteel Corp | Goldman Sachs | 188 | 1.849 | Townsquare Media Inc 'A' | HSBC | (4.207) |
| (28.458) | TimkenSteel Corp | HSBC | 17.359 | 29.367 | TPG RE Finance Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 203 |
| (12.308) | TimkenSteel Corp | Morgan Stanley | 12.185 | (3.767) | TPI Composites Inc | HSBC | 21.732 |
| 3.664 | Tingo Group Inc | Barclays Bank | (7.768) | (19.154) | TPI Composites Inc | Bank of America Merrill Lynch | (226) |
| 6.292 | Tingo Group Inc | HSBC | (1.982) | (10.100) | Tractor Supply Co | Barclays Bank | (6.512) |
| 23.116 | Tiptree Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | 4.161 | (5.231) | Tractor Supply Co | Bank of America Merrill Lynch | 202.101 |
| 22.884 | Tiptree Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 8.479 | (751) | Trade Desk Inc 'A' | HSBC | 151.916 |
| 15.583 | Tiptree Inc 'A' (REIT) | HSBC | 8.036 | (2.049) | Trade Desk Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (4.341) |
| 26.488 | Tiptree Inc 'A' (REIT) | Morgan Stanley | 4.874 | (13.990) | Trade Desk Inc 'A' | Barclays Bank | (2.541) |
| 7.401 | Titan International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.293) | (14.355) | Trade Desk Inc 'A' | Goldman Sachs | (80.862) |
| 4.217 | Titan International Inc | Barclays Bank | (3.289) | (5.225) | Trade Desk Inc 'A' | HSBC | (73.067) |
| 1.650 | Titan International Inc | Goldman Sachs | (957) | (2.964) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Morgan Stanley | (6.479) |
| 2.196 | Titan International Inc | HSBC | (220) | (557) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 14.496 |
| 5.560 | Titan International Inc | Morgan Stanley | (4.337) | 11.534 | Tradeweb Markets Inc 'A' | Barclays Bank | 1.944 |
| 4.370 | Titan Machinery Inc | Bank of America Merrill Lynch | (35.834) | (638) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | (64.244) |
| 3.628 | Titan Machinery Inc | Barclays Bank | (35.518) | (398) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.554 |
| 12.533 | Titan Machinery Inc | Goldman Sachs | (102.771) | (1.437) | Tradeweb Markets Inc 'A' | HSBC | 1.838 |
| 665 | Titan Machinery Inc | HSBC | (4.708) | (45.339) | Traeger Inc | Morgan Stanley | 5.015 |
| 1.944 | Titan Machinery Inc | Morgan Stanley | (19.032) | (17.106) | Traeger Inc | Barclays Bank | (3.174) |
| 11.165 | TJX Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (35.058) | (70.200) | Traeger Inc | HSBC | (14.882) |
| 43.609 | TJX Cos Inc | Barclays Bank | (101.173) | 2.003 | Trane Technologies Plc | Morgan Stanley | (4.914) |
| 9.430 | TJX Cos Inc | Goldman Sachs | (29.610) | 7.430 | Trane Technologies Plc | Bank of America Merrill Lynch | (27.561) |
| 1.972 | TJX Cos Inc | Morgan Stanley | (4.575) | 13.263 | Trane Technologies Plc | Barclays Bank | (50.822) |
| (10.682) | T-Mobile US Inc | Bank of America Merrill Lynch | 73.014 | 3.548 | Trane Technologies Plc | Goldman Sachs | (182.499) |
| (15.247) | T-Mobile US Inc | Barclays Bank | 60.531 | 1.288 | Trane Technologies Plc | HSBC | (43.853) |
| (3.726) | T-Mobile US Inc | HSBC | 23.498 | (3.295) | Transcat Inc | Morgan Stanley | (8.810) |
| (15.484) | T-Mobile US Inc | Morgan Stanley | 61.471 | (1.877) | Transcat Inc | Barclays Bank | 3.295 |
| (6.635) | Toast Inc 'A' | Goldman Sachs | (14.663) | (132) | Transcat Inc | Goldman Sachs | (4.111) |
| (3.471) | Toast Inc 'A' | HSBC | (7.592) | (599) | TransMedics Group Inc | HSBC | (832) |
| 5.359 | Toll Brothers Inc | Bank of America Merrill Lynch | 16.774 | (4.454) | TransMedics Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (274) |
| 4.389 | Toll Brothers Inc | Barclays Bank | 14.396 | (3.778) | TransMedics Group Inc | Barclays Bank | 11.803 |
| 9.023 | Toll Brothers Inc | Goldman Sachs | 28.242 | (1.344) | TransMedics Group Inc | Goldman Sachs | 12.014 |
| 41.881 | Toll Brothers Inc | HSBC | 156.635 | 40.953 | Transocean Ltd | HSBC | (1.129) |
| 4.383 | Toll Brothers Inc | Morgan Stanley | 14.376 | (79.571) | Transocean Ltd | Barclays Bank | (15.767) |
| (7.547) | Tompkins Financial Corp | Barclays Bank | 10.188 | | | Goldman Sachs | 48.140 |
| (11.543) | Tompkins Financial Corp | Goldman Sachs | (27.241) | | | | |
| (15.157) | Tompkins Financial Corp | HSBC | (7.730) | | | | |
| (21.667) | Tootsie Roll Industries Inc | Barclays Bank | (12.350) | | | | |
| 3.575 | TopBuild Corp | Bank of America Merrill Lynch | (32.139) | | | | |
| 3.266 | TopBuild Corp | Barclays Bank | (13.881) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|---------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 24.134 | Transocean Ltd | Morgan Stanley | (9.292) | (1.449) | TripAdvisor Inc | Barclays Bank | 1.406 |
| (51.569) | Transphorm Inc | Goldman Sachs | (16.502) | (9.069) | TripAdvisor Inc | HSBC | 9.250 |
| (8.439) | TransUnion | Bank of America | | (5.506) | Triumph Financial Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (25.924) | | | Merrill Lynch | (17.014) |
| (6.049) | TransUnion | Barclays Bank | 242 | (7.500) | Triumph Financial Inc | Barclays Bank | 8.475 |
| (3.793) | TransUnion | Goldman Sachs | (13.864) | (3.750) | Triumph Financial Inc | Goldman Sachs | (11.588) |
| (5.888) | TransUnion | HSBC | (16.407) | (723) | Triumph Financial Inc | HSBC | (3.272) |
| (6.769) | TransUnion | Morgan Stanley | 271 | (3.536) | Triumph Financial Inc | Morgan Stanley | 3.627 |
| 24.988 | Travel + Leisure Co | Bank of America | | 8.501 | Triumph Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 6.497 | | | Merrill Lynch | 4.676 |
| 88.793 | Travel + Leisure Co | Barclays Bank | (1.776) | 14.971 | Triumph Group Inc | Barclays Bank | (15.121) |
| 12.889 | Travel + Leisure Co | Goldman Sachs | 3.351 | (10.708) | Triumph Group Inc | Barclays Bank | 1.767 |
| 9.685 | Travelers Cos Inc | Barclays Bank | (92.298) | 7.741 | Triumph Group Inc | Goldman Sachs | 4.258 |
| 18.413 | Travelers Cos Inc | Goldman Sachs | (206.962) | 4.190 | Triumph Group Inc | HSBC | 5.447 |
| 4.631 | Travelers Cos Inc | HSBC | (50.941) | 4.368 | Triumph Group Inc | Morgan Stanley | (4.412) |
| 12.331 | Travelers Cos Inc | Morgan Stanley | (117.515) | (35.138) | Tronox Holdings Plc | Barclays Bank | 38.300 |
| 9.885 | Travere Therapeutics Inc | Barclays Bank | (1.087) | (32.072) | Tronox Holdings Plc | Goldman Sachs | 10.904 |
| 10.993 | Travere Therapeutics Inc | HSBC | 1.099 | (36.121) | Tronox Holdings Plc | HSBC | 61.767 |
| (7.859) | Treace Medical Concepts Inc | Barclays Bank | 3.615 | (14.264) | Tronox Holdings Plc | Morgan Stanley | 15.548 |
| (5.763) | Treace Medical Concepts Inc | | | 1.225 | TrueBlue Inc | Bank of America | |
| (3.085) | Tredegar Corp | Goldman Sachs | (3.112) | 7.438 | TrueBlue Inc | Merrill Lynch | 1.703 |
| | | Bank of America | | 2.782 | TrueBlue Inc | Barclays Bank | (4.760) |
| | | Merrill Lynch | 926 | 17.251 | TrueBlue Inc | Goldman Sachs | 3.867 |
| (27.697) | Tredegar Corp | Barclays Bank | 13.018 | 3.034 | TrueBlue Inc | HSBC | 30.707 |
| (20.944) | Tredegar Corp | Goldman Sachs | 6.283 | 85.355 | TrueCar Inc | Morgan Stanley | (1.942) |
| (38.718) | Tredegar Corp | HSBC | 33.297 | | | Bank of America | |
| (26.336) | Tredegar Corp | Morgan Stanley | 12.378 | 62.384 | TrueCar Inc | Merrill Lynch | (4.268) |
| 2.250 | TreeHouse Foods Inc | Barclays Bank | (4.343) | 858 | Truist Financial Corp | Goldman Sachs | (3.119) |
| 10.899 | TreeHouse Foods Inc | HSBC | (69.972) | | | Bank of America | |
| (1.686) | Trex Co Inc | Bank of America | | 49.943 | Truist Financial Corp | Merrill Lynch | 2.394 |
| | | Merrill Lynch | 8.030 | 21.996 | Truist Financial Corp | Barclays Bank | 3.995 |
| 702 | Trex Co Inc | Bank of America | | 39.437 | Truist Financial Corp | Goldman Sachs | 61.369 |
| | | Merrill Lynch | (3.636) | 20.531 | Truist Financial Corp | HSBC | 75.324 |
| 3.327 | Trex Co Inc | Barclays Bank | (14.073) | (3.204) | Trupanion Inc | Morgan Stanley | 1.643 |
| (2.092) | Trex Co Inc | Goldman Sachs | 10.837 | | | Bank of America | |
| 4.651 | Trex Co Inc | HSBC | (18.418) | (3.388) | Trupanion Inc | Merrill Lynch | (4.774) |
| (1.849) | Trex Co Inc | Morgan Stanley | 7.821 | (8.144) | TrustCo Bank Corp NY | Morgan Stanley | 4.311 |
| 44.985 | Tri Pointe Homes Inc | Barclays Bank | (11.696) | (11.842) | TrustCo Bank Corp NY | Barclays Bank | 4.072 |
| 49.022 | Tri Pointe Homes Inc | Goldman Sachs | (1.961) | (5.685) | TrustCo Bank Corp NY | Goldman Sachs | (5.921) |
| (15.482) | TriCo Bancshares | Goldman Sachs | (24.616) | (5.310) | Trustmark Corp | HSBC | (1.308) |
| (9.524) | TriCo Bancshares | HSBC | (22.096) | | | Bank of America | |
| (745) | TriMas Corp | Bank of America | | (16.688) | Trustmark Corp | Merrill Lynch | (2.363) |
| | | Merrill Lynch | 52 | (41.017) | Trustmark Corp | Barclays Bank | 8.928 |
| (25.555) | TriMas Corp | Barclays Bank | 17.324 | (63.333) | Trustmark Corp | Goldman Sachs | (18.253) |
| (33.436) | TriMas Corp | Goldman Sachs | 2.341 | (13.426) | Trustmark Corp | HSBC | 16.783 |
| (31.620) | TriMas Corp | HSBC | (2.095) | 4.927 | TTEC Holdings Inc | Morgan Stanley | 7.183 |
| (2.754) | TriMas Corp | Morgan Stanley | 1.928 | 9.509 | TTEC Holdings Inc | Barclays Bank | (16.308) |
| 27.005 | Trimble Inc | Goldman Sachs | (17.013) | 3.581 | TTEC Holdings Inc | Goldman Sachs | (15.133) |
| 5.124 | Trimble Inc | HSBC | (1.896) | 4.328 | TTEC Holdings Inc | HSBC | (8.309) |
| 3.312 | Trimble Inc | Morgan Stanley | (4.769) | (1.874) | TTM Technologies Inc | Morgan Stanley | (8.651) |
| (450) | TriNet Group Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.223 | (42.700) | TTM Technologies Inc | Merrill Lynch | (1.705) |
| (9.923) | TriNet Group Inc | Barclays Bank | 51.996 | (1.441) | TTM Technologies Inc | Barclays Bank | (11.956) |
| (7.739) | TriNet Group Inc | Goldman Sachs | 38.231 | (13.605) | Tucows Inc 'A' | Morgan Stanley | (403) |
| (8.798) | TriNet Group Inc | HSBC | 20.763 | (47.813) | Tupperware Brands Corp | Barclays Bank | (24.761) |
| (3.220) | TriNet Group Inc | Morgan Stanley | 16.873 | | | Bank of America | |
| 10.963 | Trinity Industries Inc | Bank of America | | (18.671) | Tupperware Brands Corp | Merrill Lynch | (11.953) |
| | | Merrill Lynch | 2.179 | (50.656) | Tupperware Brands Corp | Barclays Bank | (2.259) |
| 17.995 | Trinity Industries Inc | Barclays Bank | (7.210) | (22.980) | Tupperware Brands Corp | Goldman Sachs | (12.664) |
| 35.261 | Trinity Industries Inc | Morgan Stanley | (13.059) | 6.911 | Tupperware Brands Corp | HSBC | (4.136) |
| (51.695) | Trinity Place Holdings Inc | Bank of America | | 10.886 | Turning Point Brands Inc | Barclays Bank | (10.505) |
| | | Merrill Lynch | (1.546) | 4.984 | Turning Point Brands Inc | Goldman Sachs | (2.722) |
| (2.631) | Trinity Place Holdings Inc | Barclays Bank | 4 | (5.116) | Turning Point Brands Inc | HSBC | (3.987) |
| (16.263) | Trinity Place Holdings Inc | Goldman Sachs | (486) | 8.531 | Turtle Beach Corp | Barclays Bank | 1.637 |
| 7.352 | Trinseo Plc | Barclays Bank | (20.144) | | TuSimple Holdings Inc 'A' | Bank of America | |
| 4.627 | Trinseo Plc | Goldman Sachs | (10.920) | (18.769) | TuSimple Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | 8.616 |
| 2.294 | Trinseo Plc | Morgan Stanley | (6.286) | | | Bank of America | |
| (4.638) | TripAdvisor Inc | Bank of America | | 6.372 | TuSimple Holdings Inc 'A' | Merrill Lynch | (18.957) |
| | | Merrill Lynch | 3.896 | 11.551 | TuSimple Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | 2.613 |
| | | | | | | HSBC | 11.320 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 8.159 | TuSimple Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 3.345 | (523) | U-Haul Holding Co | Bank of America | |
| (40.625) | TuSimple Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (13.973) | | | Merrill Lynch | 4.337 |
| 10.758 | Tutor Perini Corp | Barclays Bank | (5.271) | 8.644 | U-Haul Holding Co | Barclays Bank | (56.100) |
| 27.810 | Tutor Perini Corp | Goldman Sachs | 6.953 | (13.327) | U-Haul Holding Co | Barclays Bank | 116.078 |
| 672 | Twilio Inc 'A' | Bank of America | | 16.044 | U-Haul Holding Co | Goldman Sachs | (66.102) |
| | | Merrill Lynch | 12.615 | (2.804) | U-Haul Holding Co | Goldman Sachs | 11.328 |
| (1.378) | Twilio Inc 'A' | Bank of America | | 2.433 | U-Haul Holding Co | HSBC | (11.265) |
| | | Merrill Lynch | (26.761) | 3.288 | U-Haul Holding Co | Morgan Stanley | (21.339) |
| 9.350 | Twilio Inc 'A' | Barclays Bank | 84.991 | (3.001) | U-Haul Holding Co | Morgan Stanley | 24.018 |
| (1.344) | Twilio Inc 'A' | Barclays Bank | (9.461) | 25.429 | UiPath Inc 'A' | Barclays Bank | 7.883 |
| (5.728) | Twilio Inc 'A' | Morgan Stanley | (52.068) | 7.556 | UiPath Inc 'A' | HSBC | 26.673 |
| (5.921) | Twin Disc Inc | Goldman Sachs | 10.717 | 17.346 | UiPath Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.377 |
| (19.107) | Twin Disc Inc | HSBC | 17.961 | 463 | Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc | | |
| (9.208) | Twin Disc Inc | Morgan Stanley | 2.118 | (6.813) | Ultra Clean Holdings Inc | Barclays Bank | (30.160) |
| 11.900 | Twist Bioscience Corp | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 18.088 | (12.891) | Ultra Clean Holdings Inc | Merrill Lynch | (45.375) |
| 11.140 | Twist Bioscience Corp | Barclays Bank | 780 | (3.609) | Ultra Clean Holdings Inc | Barclays Bank | (47.826) |
| 8.260 | Twist Bioscience Corp | Goldman Sachs | 12.555 | (6.301) | Ultra Clean Holdings Inc | HSBC | (25.155) |
| 5.433 | Twist Bioscience Corp | HSBC | 8.693 | 3.886 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | (23.377) |
| 8.729 | Twist Bioscience Corp | Morgan Stanley | 611 | 19.665 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Bank of America | |
| (16.828) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.438) |
| | | Merrill Lynch | (6.812) | 1.302 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Barclays Bank | (40.510) |
| (50.105) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Barclays Bank | (6.013) | 24.008 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (482) |
| (9.910) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (5.153) | (21.699) | Ultralife Corp | HSBC | 38.413 |
| (11.333) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | HSBC | (6.403) | 3.161 | UMB Financial Corp | Morgan Stanley | 4.340 |
| (26.877) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (3.759) | 5.889 | UMB Financial Corp | Barclays Bank | (2.940) |
| (5.035) | Tyler Technologies Inc | Bank of America | | (5.987) | UMH Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (5.477) |
| | | Merrill Lynch | (17.723) | (37.804) | UMH Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3.832 |
| (3.271) | Tyler Technologies Inc | Barclays Bank | 2.355 | 12.273 | Under Armour Inc 'A' | HSBC | 14.744 |
| (4.313) | Tyler Technologies Inc | Goldman Sachs | (15.182) | (26.727) | Under Armour Inc 'A' | Barclays Bank | (3.866) |
| (4.232) | Tyler Technologies Inc | HSBC | (42.193) | 33.624 | Under Armour Inc 'A' | Barclays Bank | 8.419 |
| (2.578) | Tyler Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.856 | (10.070) | Under Armour Inc 'A' | HSBC | (52.958) |
| (930) | Tyson Foods Inc 'A' | Bank of America | | (13.373) | Under Armour Inc 'A' | HSBC | 15.860 |
| | | Merrill Lynch | 864 | (7.442) | Unifi Inc | Morgan Stanley | 4.212 |
| (2.708) | Tyson Foods Inc 'A' | Barclays Bank | (2.627) | (6.490) | UniFirst Corp | Goldman Sachs | 5.433 |
| (4.737) | Tyson Foods Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.901 | (1.741) | UniFirst Corp | Barclays Bank | (1.641) |
| 5.160 | Uber Technologies Inc | Bank of America | | (962) | UniFirst Corp | Goldman Sachs | (10.342) |
| | | Merrill Lynch | (877) | (258) | UniFirst Corp | HSBC | (9.649) |
| (5.564) | Uber Technologies Inc | Barclays Bank | 6.677 | (2.465) | Union Bankshares Inc | Morgan Stanley | (53) |
| (2.032) | Uber Technologies Inc | HSBC | 1.710 | (592) | Union Pacific Corp | Bank of America | |
| (4.130) | Ubiquiti Inc | Barclays Bank | 30.810 | (3.302) | Union Pacific Corp | Merrill Lynch | (3.574) |
| 1.059 | Ubiquiti Inc | HSBC | (30.023) | (7.624) | Union Pacific Corp | Bank of America | |
| (13.666) | Udemy Inc | HSBC | (15.212) | (402) | Union Pacific Corp | Merrill Lynch | 3.266 |
| (15.880) | Udemy Inc | Morgan Stanley | (5.144) | (12.237) | Union Pacific Corp | Barclays Bank | 18.227 |
| 13.727 | UDR Inc (REIT) | Bank of America | | 18.544 | Unisys Corp | Goldman Sachs | 50.978 |
| | | Merrill Lynch | (25.532) | | | HSBC | 1.313 |
| 6.340 | UDR Inc (REIT) | Goldman Sachs | (11.792) | 39.233 | Unisys Corp | Morgan Stanley | 67.548 |
| 3.849 | UDR Inc (REIT) | HSBC | (7.236) | 11.188 | Unisys Corp | Bank of America | |
| 11.254 | UFP Industries Inc | Bank of America | | 3.782 | Unisys Corp | Merrill Lynch | (1.669) |
| | | Merrill Lynch | (35.338) | (3.893) | United Airlines Holdings Inc | Barclays Bank | (15.301) |
| 19.068 | UFP Industries Inc | Barclays Bank | (59.111) | (7.979) | United Airlines Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.007) |
| 9.220 | UFP Industries Inc | Goldman Sachs | (28.951) | (10.583) | United Airlines Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.475) |
| 13.605 | UFP Industries Inc | HSBC | (38.502) | (478) | United Airlines Holdings Inc | Barclays Bank | (2.998) |
| 17.221 | UFP Industries Inc | Morgan Stanley | (53.385) | (558) | United Bankshares Inc | Goldman Sachs | (23.777) |
| (2.648) | UFP Technologies Inc | Barclays Bank | 291 | (12.851) | United Bankshares Inc | HSBC | (24.553) |
| (1.262) | UFP Technologies Inc | Goldman Sachs | (6.234) | (3.148) | United Bankshares Inc | Morgan Stanley | (368) |
| (776) | UFP Technologies Inc | HSBC | (9.622) | (682) | United Community Banks Inc | Bank of America | |
| 3.394 | UGI Corp | Bank of America | | (1.931) | United Community Banks Inc | Merrill Lynch | (692) |
| | | Merrill Lynch | (2.138) | (27.253) | United Community Banks Inc | Barclays Bank | 5.911 |
| (13.376) | UGI Corp | Barclays Bank | 9.631 | | | Goldman Sachs | (3.904) |
| 4.836 | UGI Corp | Barclays Bank | (3.482) | | | Bank of America | |
| 2.862 | UGI Corp | Goldman Sachs | (1.803) | | | Merrill Lynch | (982) |
| 2.687 | UGI Corp | HSBC | (6.610) | | | | |
| 7.355 | UGI Corp | Morgan Stanley | (5.296) | | | Barclays Bank | 579 |
| | | | | | | Goldman Sachs | (39.244) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (626) | United Community Banks Inc | Morgan Stanley | 188 | 12.757 | Unity Bancorp Inc | Goldman Sachs | 15.181 |
| 1.488 | United Fire Group Inc | Barclays Bank | (1.592) | 2.749 | Unity Bancorp Inc | HSBC | 3.093 |
| 8.733 | United Fire Group Inc | Goldman Sachs | (18.339) | 9.480 | Unity Bancorp Inc | Morgan Stanley | 4.645 |
| 3.439 | United Fire Group Inc | HSBC | (18.158) | 16.910 | Unity Software Inc | Bank of America | |
| 465 | United Fire Group Inc | Morgan Stanley | (498) | 7.160 | Unity Software Inc | Merrill Lynch | (7.156) |
| 6.663 | United Homes Group Inc | Goldman Sachs | (18.956) | 939 | Unity Software Inc | Barclays Bank | (6.516) |
| 2.472 | United Homes Group Inc | HSBC | 2.458 | 7.218 | Unity Software Inc | Goldman Sachs | 490 |
| 841 | United Homes Group Inc | Morgan Stanley | (2.031) | 5.783 | Unity Software Inc | HSBC | 9.816 |
| 7.922 | United Insurance Holdings Corp | HSBC | (51) | 4.424 | Unity Software Inc | Morgan Stanley | (2.403) |
| (16.409) | United Natural Foods Inc | Bank of America | | 4.424 | Univar Solutions Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.708) | 17.979 | Univar Solutions Inc | Merrill Lynch | 623 |
| (3.790) | United Natural Foods Inc | HSBC | (690) | 3.700 | Univar Solutions Inc | Barclays Bank | 1.978 |
| (7.190) | United Natural Foods Inc | Morgan Stanley | 4.356 | 31.326 | Univar Solutions Inc | Goldman Sachs | 629 |
| 772 | United Parcel Service Inc 'B' | Barclays Bank | (3.103) | 18.717 | Univar Solutions Inc | HSBC | 4.663 |
| (1.918) | United Parcel Service Inc 'B' | HSBC | 13.234 | (13.994) | Univar Solutions Inc | Morgan Stanley | 2.059 |
| 1.428 | United Parcel Service Inc 'B' | HSBC | (5.744) | | Universal Corp | Bank of America | |
| (909) | United Rentals Inc | Bank of America | | (22.388) | Universal Corp | Merrill Lynch | 14.282 |
| | | Merrill Lynch | 975 | (9.679) | Universal Corp | Barclays Bank | 35.415 |
| (1.724) | United Rentals Inc | Barclays Bank | 12.544 | (24.376) | Universal Corp | HSBC | 14.345 |
| (830) | United Rentals Inc | Goldman Sachs | (696) | (8.337) | Universal Display Corp | Morgan Stanley | 38.411 |
| (1.048) | United Rentals Inc | HSBC | 2.599 | (828) | Universal Display Corp | Barclays Bank | 12.422 |
| (1.983) | United Rentals Inc | Morgan Stanley | 13.934 | 8.622 | Universal Display Corp | Goldman Sachs | (9.033) |
| 25.405 | United Security Bancshares | Barclays Bank | 9.908 | 8.622 | Universal Electronics Inc | Bank of America | |
| 10.208 | United Security Bancshares | Goldman Sachs | 5.921 | 15.330 | Universal Electronics Inc | Merrill Lynch | (2.069) |
| 12.419 | United Security Bancshares | HSBC | 8.321 | 11.293 | Universal Electronics Inc | Barclays Bank | (18.243) |
| 5.495 | United Security Bancshares | Morgan Stanley | 2.143 | 6.312 | Universal Electronics Inc | Goldman Sachs | (2.710) |
| 2.696 | United States Cellular Corp | Bank of America | | 3.819 | Universal Electronics Inc | HSBC | (3.787) |
| | | Merrill Lynch | (1.051) | (20.360) | Universal Electronics Inc | Morgan Stanley | (4.545) |
| 57.291 | United States Cellular Corp | Barclays Bank | (33.802) | | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | Barclays Bank | 6.108 |
| 31.129 | United States Cellular Corp | Goldman Sachs | (12.141) | (25.431) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | Goldman Sachs | 33.315 |
| 9.258 | United States Cellular Corp | HSBC | (13.609) | (6.194) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | HSBC | 5.017 |
| 14.870 | United States Cellular Corp | Morgan Stanley | (8.774) | (8.888) | Universal Health Services Inc 'B' | Goldman Sachs | 76.792 |
| 269 | United States Lime & Minerals Inc | Bank of America | | 567 | Universal Health Services Inc 'B' | Goldman Sachs | (1.101) |
| | | Merrill Lynch | 2.276 | 1.185 | Universal Health Services Inc 'B' | HSBC | 2.266 |
| 1.036 | United States Lime & Minerals Inc | Barclays Bank | (52) | 296 | Universal Health Services Inc 'B' | Morgan Stanley | 538 |
| 216 | United States Lime & Minerals Inc | Goldman Sachs | 1.827 | 11.643 | Universal Insurance Holdings Inc | Barclays Bank | (12.225) |
| 456 | United States Lime & Minerals Inc | HSBC | 10.082 | 3.467 | Universal Insurance Holdings Inc | HSBC | (5.270) |
| 1.041 | United States Lime & Minerals Inc | Morgan Stanley | (52) | (2.042) | Universal Logistics Holdings Inc | Barclays Bank | (500) |
| 26.541 | United States Steel Corp | Bank of America | | (10.938) | Universal Logistics Holdings Inc | Goldman Sachs | (16.790) |
| | | Merrill Lynch | (16.190) | (14.919) | Universal Logistics Holdings Inc | HSBC | (26.332) |
| 7.215 | United States Steel Corp | Barclays Bank | (6.277) | (799) | Universal Logistics Holdings Inc | Morgan Stanley | (196) |
| 2.485 | United States Steel Corp | Goldman Sachs | (1.516) | 507 | Universal Technical Institute Inc | Bank of America | |
| 28.947 | United States Steel Corp | HSBC | (22.000) | 12.201 | Universal Technical Institute Inc | Merrill Lynch | 188 |
| 31.150 | United States Steel Corp | Morgan Stanley | (27.101) | 30.115 | Universal Technical Institute Inc | Barclays Bank | (488) |
| 1.209 | United Therapeutics Corp | Bank of America | | 7.929 | Universal Technical Institute Inc | Goldman Sachs | 11.143 |
| | | Merrill Lynch | (4.095) | 14.486 | Universal Technical Institute Inc | HSBC | 3.092 |
| 631 | United Therapeutics Corp | Barclays Bank | (6.203) | 8.556 | Univest Financial Corp | Morgan Stanley | (579) |
| 217 | United Therapeutics Corp | Goldman Sachs | (1.224) | 32.277 | Univest Financial Corp | Bank of America | |
| 812 | United Therapeutics Corp | HSBC | 816 | 56.743 | Univest Financial Corp | Merrill Lynch | 12.064 |
| 1.545 | United Therapeutics Corp | Morgan Stanley | (12.762) | 21.502 | Univest Financial Corp | Barclays Bank | (11.620) |
| 134 | UnitedHealth Group Inc | Goldman Sachs | (1.108) | 20.893 | Unum Group | Goldman Sachs | (9.891) |
| 933 | UnitedHealth Group Inc | HSBC | (13.090) | | Unum Group | HSBC | (12.745) |
| 3.560 | UnitedHealth Group Inc | Morgan Stanley | (6.994) | | | | |
| (73.945) | Uniti Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | 8.134 | | | | |
| (80.802) | Uniti Group Inc (REIT) | HSBC | 10.504 | | | | |
| 5.900 | Unitil Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (25.075) | | | | |
| 6.232 | Unitil Corp | Barclays Bank | (15.144) | | | | |
| 13.939 | Unitil Corp | Goldman Sachs | (59.241) | | | | |
| 8.785 | Unitil Corp | HSBC | (39.620) | | | | |
| 1.152 | Unitil Corp | Morgan Stanley | (2.799) | | | | |
| 6.163 | Unity Bancorp Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 7.334 | | | | |
| 4.869 | Unity Bancorp Inc | Barclays Bank | 2.386 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.204) | Unum Group | HSBC | 4.731 | 1.405 | USCB Financial Holdings Inc | Morgan Stanley | 204 |
| (6.322) | Upbound Group Inc | Barclays Bank | 8.408 | (2.296) | Utah Medical Products Inc | HSBC | 2.652 |
| (11.415) | Upbound Group Inc | Goldman Sachs | 22.716 | (3.750) | Utah Medical Products Inc | Morgan Stanley | 5.044 |
| (1.396) | Upbound Group Inc | HSBC | 1.717 | 5.620 | Utz Brands Inc | Bank of America | |
| 45.331 | Upland Software Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (3.372) |
| | | Merrill Lynch | (1.360) | | | Barclays Bank | (161) |
| 32.691 | Upland Software Inc | Barclays Bank | (12.749) | 1.236 | Utz Brands Inc | Barclays Bank | (161) |
| 7.117 | Upland Software Inc | Goldman Sachs | (214) | 33.651 | Utz Brands Inc | Goldman Sachs | (20.191) |
| 38.724 | Upland Software Inc | HSBC | (19.749) | 12.083 | Utz Brands Inc | HSBC | (20.179) |
| 10.855 | Upland Software Inc | Morgan Stanley | (4.233) | (61.600) | UWM Holdings Corp | Barclays Bank | (12.320) |
| 8.560 | Upstart Holdings Inc | Barclays Bank | 5.478 | 543 | V2X Inc | Bank of America | |
| (18.100) | Upwork Inc | Goldman Sachs | 4.797 | | | Merrill Lynch | (375) |
| (159.506) | Uranium Energy Corp | Morgan Stanley | 42.269 | 3.764 | V2X Inc | Barclays Bank | (4.103) |
| (92.629) | Urban Edge Properties (REIT) | Barclays Bank | 57.430 | 12.759 | V2X Inc | Goldman Sachs | (8.348) |
| (97.054) | Urban Edge Properties (REIT) | Goldman Sachs | 104.818 | 974 | V2X Inc | HSBC | (1.273) |
| (19.452) | Urban Edge Properties (REIT) | HSBC | 24.315 | 879 | V2X Inc | Morgan Stanley | (267) |
| (6.763) | Urban One Inc | Goldman Sachs | 5.478 | (91.477) | VAALCO Energy Inc | Bank of America | |
| 29.306 | Urban Outfitters Inc | Goldman Sachs | 116.638 | (115.509) | VAALCO Energy Inc | Merrill Lynch | (9.605) |
| 24.419 | Urban Outfitters Inc | HSBC | 79.850 | (49.304) | VAALCO Energy Inc | Barclays Bank | 21.369 |
| 13.775 | Ur-Energy Inc | Bank of America | | (19.566) | VAALCO Energy Inc | HSBC | 14.249 |
| | | Merrill Lynch | (1.693) | (20.355) | Vacasa Inc 'A' | Morgan Stanley | 3.620 |
| 21.782 | Ur-Energy Inc | Barclays Bank | (2.988) | (28.341) | Vacasa Inc 'A' | HSBC | 3.019 |
| 105.254 | Ur-Energy Inc | Goldman Sachs | (12.936) | (6.638) | Vail Resorts Inc | Morgan Stanley | 238 |
| 25.000 | Ur-Energy Inc | HSBC | (2.185) | (8.506) | Vail Resorts Inc | Barclays Bank | 3.120 |
| (10.119) | Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT) | Barclays Bank | 8.196 | (7.148) | Vail Resorts Inc | Goldman Sachs | 23.051 |
| (33.955) | Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (82.511) | (32.692) | Valaris Ltd | HSBC | (8.864) |
| 7.733 | US Bancorp | Bank of America | | (16.798) | Valaris Ltd | Barclays Bank | 98.730 |
| | | Merrill Lynch | 3.944 | (24.954) | Valaris Ltd | Goldman Sachs | 28.220 |
| 7.089 | US Bancorp | Barclays Bank | (5.317) | (1.925) | Valaris Ltd | HSBC | 11.978 |
| 84.483 | US Bancorp | Goldman Sachs | 43.086 | 6.059 | Valero Energy Corp | Morgan Stanley | 5.814 |
| 5.936 | US Bancorp | HSBC | (1.932) | 3.942 | Valero Energy Corp | Barclays Bank | (29.023) |
| 13.218 | US Bancorp | Morgan Stanley | (9.914) | (4.928) | Valhi Inc | Morgan Stanley | (18.882) |
| (4.215) | US Foods Holding Corp | Goldman Sachs | 3.135 | | | Bank of America | |
| (2.024) | US Foods Holding Corp | HSBC | 482 | (3.753) | Valhi Inc | Merrill Lynch | (912) |
| (9.241) | US Foods Holding Corp | Morgan Stanley | 9.064 | (9.034) | Valhi Inc | Barclays Bank | 2.646 |
| 59.520 | US Oncology Inc | Bank of America | | (9.432) | Valhi Inc | Goldman Sachs | (1.671) |
| | | Merrill Lynch | (59) | (786) | Valhi Inc | HSBC | 12.026 |
| 7.474 | US Oncology Inc ¹ | Barclays Bank | — | (23.482) | Valley National Bancorp | Morgan Stanley | 554 |
| 41.718 | US Oncology Inc | Goldman Sachs | (42) | (304.698) | Valley National Bancorp | Barclays Bank | — |
| 8.296 | US Oncology Inc ¹ | Morgan Stanley | — | (307.180) | Valley National Bancorp | Goldman Sachs | (204.148) |
| (8.989) | US Physical Therapy Inc | Barclays Bank | 100.227 | 3.426 | Valmont Industries Inc | HSBC | (110.585) |
| 12.405 | US Silica Holdings Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (11.785) | 8.818 | Valmont Industries Inc | Merrill Lynch | (86.746) |
| 14.146 | US Silica Holdings Inc | Barclays Bank | (21.502) | 5.186 | Valmont Industries Inc | Barclays Bank | (164.279) |
| 13.792 | US Silica Holdings Inc | Goldman Sachs | (13.102) | 2.491 | Valmont Industries Inc | Goldman Sachs | (131.309) |
| 24.043 | US Silica Holdings Inc | Morgan Stanley | (36.545) | 2.425 | Valmont Industries Inc | HSBC | (49.695) |
| 9.999 | US Xpress Enterprises Inc 'A' | Bank of America | | (571) | Value Line Inc | Morgan Stanley | (45.178) |
| | | Merrill Lynch | 300 | | | Bank of America | |
| 9.010 | US Xpress Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | 270 | (1.145) | Value Line Inc | Merrill Lynch | 2.107 |
| 6.494 | US Xpress Enterprises Inc 'A' | HSBC | 65 | (2.010) | Valvoline Inc | HSBC | 4.912 |
| 8.701 | US Xpress Enterprises Inc 'A' | Morgan Stanley | 261 | (1.594) | Valvoline Inc | Bank of America | |
| 313 | USANA Health Sciences Inc | Bank of America | | (11.658) | Valvoline Inc | Merrill Lynch | (74) |
| | | Merrill Lynch | (1.099) | 4.668 | Valvoline Inc | Barclays Bank | 877 |
| 8.951 | USANA Health Sciences Inc | Barclays Bank | (13.068) | (7.213) | Valvoline Inc | HSBC | 1.476 |
| 10.878 | USANA Health Sciences Inc | Goldman Sachs | (38.182) | (639) | Vanda Pharmaceuticals Inc | HSBC | 16.992 |
| 4.828 | USANA Health Sciences Inc | Morgan Stanley | (7.049) | (40.958) | Vanda Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 3.967 |
| 5.474 | USCB Financial Holdings Inc | Barclays Bank | 794 | (10.202) | Vanda Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 134 |
| 3.005 | USCB Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.200 | 18.217 | Varex Imaging Corp | Goldman Sachs | 13.516 |
| 1.961 | USCB Financial Holdings Inc | HSBC | 2.285 | 938 | Varex Imaging Corp | Morgan Stanley | 2.142 |
| | | | | 16.873 | Varex Imaging Corp | Barclays Bank | (8.380) |
| | | | | 4.252 | Varonis Systems Inc | Goldman Sachs | (438) |
| | | | | | | HSBC | (5.399) |
| | | | | 36.931 | Varonis Systems Inc | Bank of America | |
| | | | | 9.314 | Varonis Systems Inc | Merrill Lynch | 6.888 |
| | | | | 15.253 | Varonis Systems Inc | Barclays Bank | 27.329 |
| | | | | 2.627 | Varonis Systems Inc | Goldman Sachs | 15.088 |
| | | | | (41.725) | Vaxart Inc | HSBC | 40.573 |
| | | | | (6.056) | Vaxart Inc | Morgan Stanley | 1.944 |
| | | | | | | Barclays Bank | 7.511 |
| | | | | | | Goldman Sachs | 848 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (14.997) | Vaxart Inc | HSBC | (5.535) | (2.472) | Veris Residential Inc (REIT) | Bank of America | |
| (17.794) | Vaxcyte Inc | Barclays Bank | 11.125 | | | Merrill Lynch | 297 |
| (2.345) | Vaxcyte Inc | HSBC | 2.183 | (18.143) | Veris Residential Inc (REIT) | Barclays Bank | 5.443 |
| (7.036) | Vaxcyte Inc | Morgan Stanley | 4.221 | (22.928) | Veris Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.751 |
| (2.631) | VBI Vaccines Inc | Bank of America | | (9.685) | Veris Residential Inc (REIT) | HSBC | 1.162 |
| | | Merrill Lynch | 263 | 6.389 | VeriSign Inc | Bank of America | |
| (3.574) | VBI Vaccines Inc | Barclays Bank | 500 | | | Merrill Lynch | (8.611) |
| (821) | VBI Vaccines Inc | Goldman Sachs | 82 | 10.775 | VeriSign Inc | Barclays Bank | (41.591) |
| (999) | VBI Vaccines Inc | HSBC | (20) | 1.437 | VeriSign Inc | Goldman Sachs | (622) |
| (22.778) | Vector Group Ltd | Barclays Bank | (2.278) | 827 | VeriSign Inc | HSBC | 3.200 |
| (50.681) | Vector Group Ltd | Goldman Sachs | (25.847) | 6.400 | VeriSign Inc | Morgan Stanley | (24.704) |
| (11.837) | Vector Group Ltd | HSBC | 9.114 | (2.131) | Verisk Analytics Inc | Barclays Bank | (2.218) |
| 10.906 | Veeco Instruments Inc | Bank of America | | (1.437) | Verisk Analytics Inc | HSBC | 790 |
| | | Merrill Lynch | 28.137 | (374) | Verisk Analytics Inc | Morgan Stanley | 52 |
| 19.842 | Veeco Instruments Inc | HSBC | 98.416 | (230) | Veritiv Corp | Bank of America | |
| 26.336 | Veeco Instruments Inc | Morgan Stanley | 31.603 | | | Merrill Lynch | 1.603 |
| 304 | Veeva Systems Inc 'A' | Bank of America | | (2.934) | Veritiv Corp | Barclays Bank | 29.294 |
| | | Merrill Lynch | (294) | (901) | Veritiv Corp | Goldman Sachs | 6.280 |
| 561 | Veeva Systems Inc 'A' | Barclays Bank | (84) | (1.269) | Veritiv Corp | HSBC | 11.446 |
| 969 | Veeva Systems Inc 'A' | Morgan Stanley | (145) | (1.281) | Veritiv Corp | Morgan Stanley | 11.832 |
| (48.982) | Velo3D Inc | HSBC | 12.246 | 13.412 | Veritone Inc | Bank of America | |
| (18.325) | Velo3D Inc | Morgan Stanley | (367) | | | Merrill Lynch | 671 |
| 6.068 | Velocity Financial Inc | Bank of America | | 7.897 | Veritone Inc | Goldman Sachs | 395 |
| | | Merrill Lynch | — | 10.725 | Veritone Inc | Morgan Stanley | 1.716 |
| 3.809 | Velocity Financial Inc | Barclays Bank | — | (12.191) | Verizon Communications Inc | Bank of America | |
| 8.820 | Velocity Financial Inc | Goldman Sachs | — | | | Merrill Lynch | 18.165 |
| 14.407 | Velocity Financial Inc | HSBC | 2.305 | (5.874) | Verizon Communications Inc | Barclays Bank | 3.994 |
| 20.008 | Velocity Financial Inc | Morgan Stanley | — | | | | |
| 2.972 | Ventas Inc (REIT) | Bank of America | | (2.089) | Verizon Communications Inc | Goldman Sachs | 3.113 |
| | | Merrill Lynch | 224 | (7.453) | Verizon Communications Inc | HSBC | 19.005 |
| 8.524 | Ventas Inc (REIT) | Barclays Bank | (12.530) | (3.947) | Verizon Communications Inc | Morgan Stanley | 2.684 |
| 4.363 | Ventas Inc (REIT) | Goldman Sachs | 478 | (4.819) | Verra Mobility Corp | Bank of America | |
| (1.341) | Ventas Inc (REIT) | HSBC | 6.035 | | | Merrill Lynch | (675) |
| 2.123 | Ventas Inc (REIT) | Morgan Stanley | (3.314) | (34.930) | Verra Mobility Corp | Barclays Bank | 6.287 |
| (491) | Ventyx Biosciences Inc | Bank of America | | (52.739) | Verra Mobility Corp | Goldman Sachs | (7.383) |
| | | Merrill Lynch | 791 | (12.483) | Verra Mobility Corp | HSBC | (2.247) |
| (3.097) | Ventyx Biosciences Inc | Barclays Bank | 3.593 | (4.945) | Verra Mobility Corp | Morgan Stanley | 890 |
| (2.683) | Ventyx Biosciences Inc | HSBC | 8.932 | (4.709) | Verrica Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| (5.798) | Ventyx Biosciences Inc | Morgan Stanley | 6.726 | | | Merrill Lynch | 3.673 |
| 16.632 | Vera Bradley Inc | Barclays Bank | (5.489) | (3.298) | Verrica Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 1.451 |
| 19.926 | Vera Bradley Inc | Goldman Sachs | (10.959) | (10.174) | Verrica Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 7.936 |
| 14.954 | Vera Bradley Inc | HSBC | (8.524) | (2.085) | Verrica Pharmaceuticals Inc | HSBC | 2.711 |
| 15.327 | Vera Bradley Inc | Morgan Stanley | (5.058) | (2.050) | Verrica Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 902 |
| (8.498) | Vera Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (765) | (3.963) | Vertex Energy Inc | Barclays Bank | 2.100 |
| (6.740) | Vera Therapeutics Inc | HSBC | (3.370) | (14.304) | Vertex Energy Inc | HSBC | 9.144 |
| (2.789) | Vera Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 167 | (19.512) | Vertex Energy Inc | Morgan Stanley | 10.341 |
| 4.749 | Veracyte Inc | Bank of America | | 8.027 | Vertex Inc 'A' | Barclays Bank | (2.127) |
| | | Merrill Lynch | 2.375 | 11.575 | Vertex Inc 'A' | Goldman Sachs | 25.465 |
| 5.024 | Veracyte Inc | Barclays Bank | (3.467) | 5.593 | Vertex Inc 'A' | HSBC | 6.544 |
| 7.975 | Veracyte Inc | Goldman Sachs | 3.988 | (715) | Vertex Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 11.311 |
| 9.151 | Veracyte Inc | Morgan Stanley | (6.314) | 131 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (2.072) |
| 6.703 | Veradigm Inc | Bank of America | | 687 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (7.943) |
| | | Merrill Lynch | 34 | (859) | Vertex Pharmaceuticals Inc | HSBC | 17.128 |
| 61.248 | Veradigm Inc | Barclays Bank | (14.393) | 80 | Vertex Pharmaceuticals Inc | HSBC | (679) |
| 12.740 | Verastem Inc | Barclays Bank | 6.880 | (322) | Vertex Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 5.094 |
| 12.557 | Verastem Inc | Goldman Sachs | 7.419 | 895 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (8.202) |
| 44.735 | Verastem Inc | HSBC | 26.394 | 3.962 | Vertiv Holdings Co | Bank of America | |
| 3.101 | Verastem Inc | Morgan Stanley | 1.675 | | | Merrill Lynch | 14.303 |
| 669 | Vericel Corp | Bank of America | | 8.427 | Vertiv Holdings Co | Barclays Bank | 20.393 |
| | | Merrill Lynch | (1.142) | 20.660 | Vertiv Holdings Co | Morgan Stanley | 49.997 |
| 6.482 | Vericel Corp | Barclays Bank | (11.019) | (34.627) | Veru Inc | Barclays Bank | 2.424 |
| 3.036 | Vericel Corp | Goldman Sachs | (2.823) | (15.683) | Veru Inc | Goldman Sachs | 1.098 |
| 1.454 | Vericel Corp | HSBC | 88 | (5.960) | Verve Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 1.655 | Vericel Corp | Morgan Stanley | (591) | | | Merrill Lynch | 10.490 |
| 5.334 | Verint Systems Inc | Bank of America | | (2.234) | Verve Therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.055 |
| | | Merrill Lynch | 8.748 | (4.540) | Verve Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 4.177 |
| 7.599 | Verint Systems Inc | Barclays Bank | 1.444 | 9.203 | VF Corp | Barclays Bank | (20.799) |
| 9.332 | Verint Systems Inc | HSBC | 16.984 | | | | |
| 3.557 | Verint Systems Inc | Morgan Stanley | 676 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|--------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.496 | VF Corp | HSBC | (2.043) | (10.038) | Vinco Ventures Inc | Morgan Stanley | 3.112 |
| (2.937) | VF Corp | Morgan Stanley | 6.638 | 8.125 | Vintage Wine Estates Inc | Bank of America | |
| 4.376 | VF Corp | Morgan Stanley | (9.890) | | | Merrill Lynch | 41 |
| (1.822) | Via Renewables Inc | Bank of America | | 21.645 | Vintage Wine Estates Inc | Barclays Bank | (974) |
| | | Merrill Lynch | 3.662 | 4.999 | Vintage Wine Estates Inc | Goldman Sachs | 25 |
| (4.228) | Via Renewables Inc | Barclays Bank | 6.553 | 10.166 | Vintage Wine Estates Inc | HSBC | (2.694) |
| (3.544) | Via Renewables Inc | HSBC | (71) | 13.492 | Vintage Wine Estates Inc | Morgan Stanley | (607) |
| (5.966) | Via Renewables Inc | Morgan Stanley | 9.247 | 1.899 | Vir Biotechnology Inc | Bank of America | |
| 5.024 | Viad Corp | Barclays Bank | (6.983) | | | Merrill Lynch | 1.405 |
| 2.637 | Viad Corp | Goldman Sachs | 1.450 | 4.594 | Vir Biotechnology Inc | Barclays Bank | 2.940 |
| 4.100 | Viad Corp | HSBC | 7.585 | 6.651 | Vir Biotechnology Inc | Goldman Sachs | 4.922 |
| 7.990 | Viad Corp | Morgan Stanley | (11.106) | (1.523) | Vir Biotechnology Inc | Goldman Sachs | (1.127) |
| 1.454 | Viant Technology Inc 'A' | Barclays Bank | 145 | 1.887 | Vir Biotechnology Inc | HSBC | 4.227 |
| 14.621 | Viant Technology Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.023 | 5.127 | Vir Biotechnology Inc | Morgan Stanley | 3.281 |
| 3.526 | Viant Technology Inc 'A' | HSBC | 1.446 | (2.977) | Vir Biotechnology Inc | Morgan Stanley | (1.905) |
| 1.895 | Viant Technology Inc 'A' | Morgan Stanley | 190 | 2.668 | Viracta Therapeutics Inc | Barclays Bank | (1.601) |
| (2.237) | Viasat Inc | Bank of America | | 300 | Viracta Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 24 |
| | | Merrill Lynch | (17.157) | (23.311) | Virgin Galactic Holdings Inc | Bank of America | |
| (5.067) | Viasat Inc | Barclays Bank | (1.773) | | | Merrill Lynch | 13.753 |
| (1.526) | Viasat Inc | HSBC | (12.559) | (66.028) | Virgin Galactic Holdings Inc | Barclays Bank | 99.042 |
| (4.095) | Viasat Inc | Morgan Stanley | (1.434) | (144.306) | Virgin Galactic Holdings Inc | Morgan Stanley | 216.459 |
| (87.657) | Viatrix Inc | Barclays Bank | 31.557 | (6.419) | Viridian Therapeutics Inc | Bank of America | |
| (79.861) | Viatrix Inc | Goldman Sachs | 20.764 | | | Merrill Lynch | (2.054) |
| (14.325) | Viatrix Inc | Morgan Stanley | 5.157 | (2.253) | Viridian Therapeutics Inc | Barclays Bank | 2.276 |
| (11.124) | Viavi Solutions Inc | Bank of America | | (4.506) | Viridian Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.442) |
| | | Merrill Lynch | (2.837) | (2.807) | Viridian Therapeutics Inc | HSBC | 4.884 |
| (61.060) | Viavi Solutions Inc | Barclays Bank | (13.636) | (2.353) | Viridian Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 2.377 |
| (51.205) | Viavi Solutions Inc | HSBC | (33.683) | (142.482) | VirnetX Holding Corp | Goldman Sachs | (1.040) |
| (71.203) | Viavi Solutions Inc | Morgan Stanley | (12.091) | 35.788 | Virtu Financial Inc 'A' | Barclays Bank | (15.031) |
| (41.990) | Vicarious Surgical Inc | HSBC | 2.939 | 18.645 | Virtu Financial Inc 'A' | Goldman Sachs | (5.407) |
| (5.648) | Vicarious Surgical Inc | Morgan Stanley | 1.299 | 39.379 | Virtu Financial Inc 'A' | HSBC | 2.832 |
| 75.732 | VICI Properties Inc (REIT) | Barclays Bank | (82.548) | 8.113 | Virtu Financial Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.407) |
| 26.247 | VICI Properties Inc (REIT) | HSBC | (64.305) | 894 | Virtus Investment Partners Inc | Barclays Bank | 7.206 |
| 15.785 | VICI Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (17.206) | 7.552 | Visa Inc 'A' | Barclays Bank | (105.426) |
| (424) | Vicor Corp | Bank of America | | 7.618 | Visa Inc 'A' | Goldman Sachs | (113.362) |
| | | Merrill Lynch | (6.101) | 18.949 | Visa Inc 'A' | Morgan Stanley | (258.528) |
| (1.732) | Vicor Corp | Barclays Bank | (15.328) | (35.301) | Vishay Intertechnology Inc | Bank of America | |
| (2.542) | Vicor Corp | Goldman Sachs | (36.579) | | | Merrill Lynch | (56.482) |
| (850) | Vicor Corp | HSBC | (5.748) | (65.561) | Vishay Intertechnology Inc | Barclays Bank | (27.536) |
| (410) | Vicor Corp | Morgan Stanley | (3.629) | (20.554) | Vishay Intertechnology Inc | HSBC | (90.438) |
| (5.491) | Victoria's Secret & Co | Bank of America | | (41.319) | Vishay Intertechnology Inc | Morgan Stanley | (17.354) |
| | | Merrill Lynch | 28.443 | (1.129) | Vishay Precision Group Inc | Bank of America | |
| (13.661) | Victoria's Secret & Co | Barclays Bank | 59.698 | | | Merrill Lynch | 188 |
| (1.808) | Victoria's Secret & Co | Goldman Sachs | 9.365 | (697) | Vishay Precision Group Inc | Barclays Bank | 1.151 |
| (8.446) | Victoria's Secret & Co | HSBC | 51.943 | (2.153) | Vishay Precision Group Inc | Goldman Sachs | (1.486) |
| (4.426) | Victoria's Secret & Co | Morgan Stanley | 19.342 | (1.214) | Vishay Precision Group Inc | HSBC | 3.055 |
| 523 | Victory Capital Holdings Inc 'A' | Bank of America | | (1.933) | Vishay Precision Group Inc | Morgan Stanley | 621 |
| | | Merrill Lynch | 236 | (25.256) | VistaGen Therapeutics Inc | Bank of America | |
| 24.547 | Victory Capital Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (37.557) | | | Merrill Lynch | (748) |
| 8.170 | Victory Capital Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | — | (80.551) | VistaGen Therapeutics Inc | Barclays Bank | (2.698) |
| 8.955 | Victory Capital Holdings Inc 'A' | HSBC | 6.716 | (19.547) | VistaGen Therapeutics Inc | HSBC | (848) |
| (20.446) | Viemed Healthcare Inc | Barclays Bank | 7.974 | 3.740 | Visteon Corp | Bank of America | |
| (9.658) | Viking Therapeutics Inc | Barclays Bank | 33.224 | 6.985 | Visteon Corp | Merrill Lynch | (7.892) |
| (21.092) | Village Super Market Inc 'A' | Barclays Bank | 8.015 | 5.863 | Visteon Corp | Barclays Bank | (47.568) |
| (14.460) | Village Super Market Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.892 | 3.912 | Visteon Corp | Goldman Sachs | (12.371) |
| 1.137 | Vimeo Inc | Bank of America | | 7.947 | Visteon Corp | HSBC | (14.553) |
| | | Merrill Lynch | 159 | (3.073) | Vistra Corp | Morgan Stanley | (54.119) |
| 59.036 | Vimeo Inc | Barclays Bank | (8.265) | (6.129) | Vistra Corp | Barclays Bank | 2.520 |
| 93.220 | Vimeo Inc | Goldman Sachs | 13.051 | (11.445) | Vistra Corp | HSBC | 4.243 |
| 117.716 | Vimeo Inc | HSBC | 25.897 | 3.956 | Vita Coco Co Inc | Morgan Stanley | 9.385 |
| 79.206 | Vimeo Inc | Morgan Stanley | (11.089) | 10.466 | Vita Coco Co Inc | Bank of America | |
| (11.185) | Vince Holding Corp | Barclays Bank | 1.342 | 4.135 | Vita Coco Co Inc | Merrill Lynch | 8.012 |
| (13.418) | Vince Holding Corp | Morgan Stanley | 1.610 | (1.491) | Vital Energy Inc | HSBC | 20.017 |
| 2.907 | Vincerox Pharma Inc | Bank of America | | | | Morgan Stanley | 13.191 |
| | | Merrill Lynch | 581 | (4.752) | Vital Energy Inc | Bank of America | |
| 2.533 | Vincerox Pharma Inc | Barclays Bank | 532 | (2.753) | Vital Energy Inc | Merrill Lynch | 790 |
| 7.067 | Vincerox Pharma Inc | Morgan Stanley | 1.484 | (5.369) | Vital Energy Inc | Barclays Bank | 20.909 |
| | | | | | | Goldman Sachs | 1.459 |
| | | | | | | HSBC | 11.322 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (524) | Vital Energy Inc | Morgan Stanley | 2.306 | 9.465 | Wabash National Corp | Morgan Stanley | (10.509) |
| 33.395 | Vital Farms Inc | Barclays Bank | (39.740) | (1.314) | Waitr Holdings Inc | Goldman Sachs | (7) |
| 1.185 | Vital Farms Inc | Goldman Sachs | (593) | 10.185 | Walgreens Boots Alliance Inc | Bank of America | |
| 12.546 | Vital Farms Inc | HSBC | (18.443) | (27.496) | Walgreens Boots Alliance Inc | Merrill Lynch | (4.130) |
| (894) | Vitesse Energy Inc | Bank of America | | 9.110 | Walgreens Boots Alliance Inc | Barclays Bank | 35.745 |
| (26.250) | Vitesse Energy Inc | Merrill Lynch | (3.549) | 9.022 | Walgreens Boots Alliance Inc | Barclays Bank | (4.262) |
| (1.126) | Vitesse Energy Inc | Barclays Bank | (18.884) | 12.696 | Walgreens Boots Alliance Inc | Goldman Sachs | (375) |
| (5.619) | Vitesse Energy Inc | Goldman Sachs | (4.470) | 21.647 | Walgreens Boots Alliance Inc | HSBC | (22.472) |
| (12.618) | Vitesse Energy Inc | HSBC | (23.302) | (229) | Walker & Dunlop Inc | Morgan Stanley | (28.141) |
| (14.154) | Vivid Seats Inc 'A' | Morgan Stanley | (8.326) | (4.110) | Walker & Dunlop Inc | Bank of America | |
| (18.230) | Vivid Seats Inc 'A' | Bank of America | | (1.371) | Walker & Dunlop Inc | Merrill Lynch | (338) |
| (2.548) | Vivid Seats Inc 'A' | Merrill Lynch | 30.573 | (8.140) | Walker & Dunlop Inc | Barclays Bank | 3.750 |
| (26.768) | Vizio Holding Corp 'A' | Goldman Sachs | 39.377 | 4.944 | Walker & Dunlop Inc | HSBC | (224) |
| (3.397) | Vontier Corp | HSBC | 1.350 | 35.442 | Walmart Inc | Morgan Stanley | (33.075) |
| (44.282) | Vontier Corp | Barclays Bank | 11.778 | 14.954 | Walmart Inc | Barclays Bank | (120.503) |
| (27.430) | Vontier Corp | Barclays Bank | (1.189) | 12.171 | Walmart Inc | Goldman Sachs | (100.043) |
| (24.696) | Vontier Corp | Goldman Sachs | (50.039) | 7.671 | Walmart Inc | HSBC | (91.648) |
| 1.823 | Vor BioPharma Inc | HSBC | (56.231) | (16.409) | Walt Disney Co | Morgan Stanley | (26.082) |
| 6.675 | Vor BioPharma Inc | Morgan Stanley | (8.644) | (3.216) | Walt Disney Co | Goldman Sachs | 86.475 |
| 3.729 | Vor BioPharma Inc | Bank of America | | (15.929) | Walt Disney Co | HSBC | 15.176 |
| 3.161 | Vor BioPharma Inc | Merrill Lynch | 273 | 10.333 | Warby Parker Inc 'A' | Bank of America | |
| (7.258) | Vornado Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 1.001 | 15.944 | Warby Parker Inc 'A' | Merrill Lynch | (9.506) |
| (34.651) | Vornado Realty Trust (REIT) | HSBC | 1.603 | 10.115 | Warby Parker Inc 'A' | Barclays Bank | (11.161) |
| (5.435) | Vornado Realty Trust (REIT) | Morgan Stanley | (1.233) | 2.635 | Warner Music Group Corp 'A' | HSBC | (9.002) |
| (28.578) | Vornado Realty Trust (REIT) | Bank of America | | 7.545 | Warner Music Group Corp 'A' | Bank of America | |
| (26.909) | Vornado Realty Trust (REIT) | Merrill Lynch | (8.419) | 2.408 | Warner Music Group Corp 'A' | Goldman Sachs | (17.807) |
| (9.139) | VOXX International Corp | Barclays Bank | (2.079) | 4.463 | Warner Music Group Corp 'A' | HSBC | (10.860) |
| (17.167) | VOXX International Corp | Goldman Sachs | (3.902) | 3.740 | Warrior Met Coal Inc | Morgan Stanley | (10.131) |
| (15.435) | VOXX International Corp | HSBC | 1.246 | 3.579 | Warrior Met Coal Inc | Bank of America | |
| (5.352) | VOXX International Corp | Morgan Stanley | (1.615) | 2.277 | Warrior Met Coal Inc | Merrill Lynch | (11.900) |
| (3.592) | Voya Financial Inc | Merrill Lynch | 22.025 | 4.261 | Warrior Met Coal Inc | Barclays Bank | (8.754) |
| (4.823) | Voya Financial Inc | Barclays Bank | (858) | (11.701) | Washington Federal Inc | Goldman Sachs | (9.290) |
| (2.873) | Voya Financial Inc | Goldman Sachs | 37.198 | (67.130) | Washington Federal Inc | Morgan Stanley | (10.951) |
| (11.939) | Voya Financial Inc | HSBC | 17.822 | (7.324) | Washington Federal Inc | Barclays Bank | 10.063 |
| 12.357 | Voyager Therapeutics Inc | Bank of America | | 7.765 | Washington Trust Bancorp Inc | HSBC | (61.760) |
| 4.535 | Voyager Therapeutics Inc | Merrill Lynch | 15.199 | 28.747 | Washington Trust Bancorp Inc | Morgan Stanley | 6.299 |
| 37.021 | Vroom Inc | Goldman Sachs | 5.578 | 823 | Washington Trust Bancorp Inc | Bank of America | |
| (834) | VSE Corp | Goldman Sachs | 37 | 20.182 | Washington Trust Bancorp Inc | Merrill Lynch | (11.900) |
| (11.709) | VSE Corp | Bank of America | | 8.347 | Washington Trust Bancorp Inc | Barclays Bank | 12.074 |
| (4.428) | VSE Corp | Merrill Lynch | 242 | 7.392 | Waste Connections Inc | Barclays Bank | (16.262) |
| (575) | VSE Corp | Barclays Bank | 29.038 | 389 | Waste Connections Inc | Goldman Sachs | (2.536) |
| (1.929) | VSE Corp | Goldman Sachs | 1.284 | 879 | Waste Connections Inc | HSBC | (4.228) |
| 3.569 | Vulcan Materials Co | HSBC | 610 | (7.626) | Waste Management Inc | Bank of America | |
| 21.242 | Vulcan Materials Co | Morgan Stanley | 4.784 | (7.397) | Waste Management Inc | Merrill Lynch | 48.883 |
| 13.064 | Vulcan Materials Co | Merrill Lynch | (4.675) | (3.431) | Waste Management Inc | Barclays Bank | 15.756 |
| 6.273 | Vulcan Materials Co | Barclays Bank | (50.981) | (4.077) | Waste Management Inc | Goldman Sachs | 21.992 |
| 11.856 | Vulcan Materials Co | Goldman Sachs | (16.716) | (4.097) | Waste Management Inc | HSBC | 26.999 |
| (21.713) | Vuzix Corp | HSBC | 12.734 | (3.890) | Waters Corp | Morgan Stanley | 8.727 |
| (81.941) | Vuzix Corp | Morgan Stanley | (28.455) | | Waters Corp | Bank of America | |
| (8.149) | Vuzix Corp | Barclays Bank | (17.805) | | Waters Corp | Merrill Lynch | 86.828 |
| 36.954 | W R Berkley Corp | HSBC | (82.760) | | | | |
| 46.316 | W R Berkley Corp | Morgan Stanley | (5.899) | | | | |
| 15.600 | W R Berkley Corp | Barclays Bank | (75.016) | | | | |
| (18.499) | W&T Offshore Inc | Goldman Sachs | (124.127) | | | | |
| (20.404) | W&T Offshore Inc | Morgan Stanley | (31.668) | | | | |
| (37.982) | W&T Offshore Inc | Bank of America | | | | | |
| (53.168) | W&T Offshore Inc | Merrill Lynch | 3.884 | | | | |
| (39.102) | W&T Offshore Inc | Barclays Bank | 11.222 | | | | |
| 15.793 | Wabash National Corp | Goldman Sachs | 11.395 | | | | |
| 11.050 | Wabash National Corp | HSBC | 24.599 | | | | |
| | | Morgan Stanley | 21.506 | | | | |
| | | Goldman Sachs | (5.594) | | | | |
| | | HSBC | (6.304) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 228 | Waters Corp | Bank of America | | (157) | WESCO International Inc | Barclays Bank | (1.537) |
| | | Merrill Lynch | (5.187) | (1.246) | WESCO International Inc | Goldman Sachs | (3.455) |
| (1.395) | Waters Corp | Barclays Bank | 24.078 | 966 | WESCO International Inc | HSBC | 10.085 |
| 148 | Waters Corp | Barclays Bank | (2.554) | (533) | WESCO International Inc | HSBC | (3.581) |
| (2.361) | Waters Corp | Morgan Stanley | 36.799 | (9.082) | West BanCorp Inc | Bank of America | |
| (13.282) | Waterstone Financial Inc | Barclays Bank | 266 | | | Merrill Lynch | (14.168) |
| (20.595) | Waterstone Financial Inc | Goldman Sachs | (11.533) | (14.768) | West BanCorp Inc | Barclays Bank | (1.477) |
| (8.646) | Waterstone Financial Inc | HSBC | 1.902 | (10.374) | West BanCorp Inc | Goldman Sachs | (16.183) |
| 657 | Watsco Inc | Barclays Bank | 278 | (2.265) | West BanCorp Inc | HSBC | (2.831) |
| 372 | Watsco Inc | Goldman Sachs | 3.583 | (1.558) | West BanCorp Inc | Morgan Stanley | (156) |
| 2.918 | Watsco Inc | HSBC | (379) | (2.749) | West Pharmaceutical Services Inc | Bank of America | |
| 1.151 | Watsco Inc | Morgan Stanley | 4.431 | | | Merrill Lynch | 63.887 |
| 3.469 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Bank of America | | (4.741) | West Pharmaceutical Services Inc | Barclays Bank | 89.984 |
| | | Merrill Lynch | (6.940) | | | Goldman Sachs | 13.479 |
| 8.578 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Barclays Bank | (34.312) | (580) | West Pharmaceutical Services Inc | Goldman Sachs | 13.479 |
| 1.851 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.649) | (573) | West Pharmaceutical Services Inc | HSBC | 18.331 |
| 3.975 | Watts Water Technologies Inc 'A' | HSBC | (15.121) | (738) | West Pharmaceutical Services Inc | Morgan Stanley | 14.007 |
| 6.817 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Morgan Stanley | (26.959) | (1.415) | Western Alliance Bancorp | Barclays Bank | 4.953 |
| 7.020 | WaVe Life Sciences Ltd | Barclays Bank | 1.193 | (10.883) | Western Digital Corp | Bank of America | |
| 5.923 | WaVe Life Sciences Ltd | HSBC | (592) | | | Merrill Lynch | (22.540) |
| 12.798 | Wayfair Inc 'A' | Bank of America | | (3.294) | Western Digital Corp | Barclays Bank | (1.746) |
| | | Merrill Lynch | 45.561 | (7.514) | Western Digital Corp | HSBC | (16.163) |
| 2.068 | Wayfair Inc 'A' | Barclays Bank | 12.139 | (7.589) | Western Digital Corp | Morgan Stanley | (4.022) |
| 5.214 | Wayfair Inc 'A' | Goldman Sachs | 18.562 | 45.008 | Western New England Bancorp Inc | Bank of America | |
| 10.878 | Wayfair Inc 'A' | Morgan Stanley | 63.854 | | | Merrill Lynch | (6.751) |
| (7.731) | WD-40 Co | Barclays Bank | 18.013 | 31.300 | Western New England Bancorp Inc | Barclays Bank | (7.199) |
| (6.140) | WD-40 Co | Goldman Sachs | (3.500) | 28.433 | Western New England Bancorp Inc | Goldman Sachs | (4.265) |
| (3.089) | WD-40 Co | HSBC | (18.194) | 19.309 | Western New England Bancorp Inc | HSBC | (5.213) |
| (752) | WD-40 Co | Morgan Stanley | 1.752 | 22.070 | Western New England Bancorp Inc | Morgan Stanley | (5.076) |
| 2.404 | Weave Communications Inc | HSBC | 55 | 43.237 | Western Union Co | Barclays Bank | (36.751) |
| (10.683) | Webster Financial Corp | Bank of America | | 3.624 | Western Union Co | Morgan Stanley | (3.080) |
| | | Merrill Lynch | (23.274) | (11.319) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Barclays Bank | 64.292 |
| (840) | Webster Financial Corp | Barclays Bank | 1.226 | (7.010) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Goldman Sachs | 40.238 |
| (8.785) | Webster Financial Corp | Goldman Sachs | (22.753) | (1.493) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | HSBC | 9.052 |
| (6.929) | Webster Financial Corp | HSBC | (20.995) | (5.034) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Morgan Stanley | 28.593 |
| (9.033) | Webster Financial Corp | Morgan Stanley | 6.148 | 3.092 | Westlake Corp | Bank of America | |
| (12.187) | WEC Energy Group Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (30.271) |
| | | Merrill Lynch | 45.559 | 6.879 | Westlake Corp | Barclays Bank | (65.633) |
| (9.406) | WEC Energy Group Inc | Barclays Bank | 28.650 | 2.222 | Westlake Corp | Goldman Sachs | (21.753) |
| (26.227) | WEC Energy Group Inc | Goldman Sachs | 145.645 | 6.505 | Westlake Corp | HSBC | (78.474) |
| (75.167) | WEC Energy Group Inc | HSBC | 612.583 | 4.941 | Westlake Corp | Morgan Stanley | (52.024) |
| (32.426) | WEC Energy Group Inc | Morgan Stanley | 97.321 | 2.688 | Westrock Co | Bank of America | |
| (1.256) | Weis Markets Inc | Barclays Bank | 7.260 | | | Merrill Lynch | 457 |
| (2.950) | Weis Markets Inc | Goldman Sachs | 27.110 | 47.287 | Westrock Co | Barclays Bank | 473 |
| (2.865) | Weis Markets Inc | HSBC | 51.455 | 23.581 | Westrock Co | HSBC | (621) |
| (5.233) | Wells Fargo & Co | Bank of America | | 1.187 | Westrock Co | Morgan Stanley | 12 |
| | | Merrill Lynch | (6.489) | 498 | Westwood Holdings Group Inc | Goldman Sachs | 70 |
| (18.059) | Wells Fargo & Co | Barclays Bank | 17.661 | 28.554 | WeWork Inc 'A' | Barclays Bank | (657) |
| (840) | Wells Fargo & Co | Goldman Sachs | (1.042) | 70.720 | WeWork Inc 'A' | Goldman Sachs | (13.578) |
| (17.847) | Wells Fargo & Co | HSBC | (13.380) | 49.312 | WeWork Inc 'A' | HSBC | (13.285) |
| (10.979) | Wells Fargo & Co | Morgan Stanley | 10.650 | 15.135 | WeWork Inc 'A' | Morgan Stanley | (348) |
| (7.410) | Welltower Inc (REIT) | Bank of America | | (3.097) | Weyco Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 49.721 | | | Merrill Lynch | 697 |
| (30.425) | Welltower Inc (REIT) | Barclays Bank | 93.405 | (5.501) | Weyco Group Inc | Barclays Bank | 4.538 |
| (23.932) | Welltower Inc (REIT) | HSBC | 69.642 | (9.204) | Weyco Group Inc | Goldman Sachs | 2.071 |
| (11.089) | Welltower Inc (REIT) | Morgan Stanley | 34.043 | (33.663) | Weyerhaeuser Co (REIT) | Goldman Sachs | 55.544 |
| 31.213 | Wendy's Co | Bank of America | | 4.339 | Weyerhaeuser Co (REIT) | Goldman Sachs | 79 |
| | | Merrill Lynch | (58.368) | 13.567 | Weyerhaeuser Co (REIT) | Morgan Stanley | (2.049) |
| 68.443 | Wendy's Co | Barclays Bank | (49.279) | | | | |
| 3.142 | Wendy's Co | HSBC | (2.828) | | | | |
| 14.219 | Wendy's Co | Morgan Stanley | (10.238) | | | | |
| (14.645) | Werner Enterprises Inc | Barclays Bank | 3.954 | | | | |
| (7.976) | Werner Enterprises Inc | Morgan Stanley | 2.154 | | | | |
| 35.131 | WesBanco Inc | Barclays Bank | 10.539 | | | | |
| 13.405 | WesBanco Inc | Goldman Sachs | 30.831 | | | | |
| 8.106 | WESCO International Inc | Barclays Bank | 49.528 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 15.579 | Whirlpool Corp | Barclays Bank | (41.129) | 13.247 | Winnebago Industries Inc | Barclays Bank | (3.577) |
| 12.137 | Whirlpool Corp | Goldman Sachs | (30.384) | 2.780 | Winnebago Industries Inc | HSBC | (8.618) |
| 338 | Whirlpool Corp | HSBC | (895) | 5.233 | Wintrust Financial Corp | HSBC | 6.384 |
| 9.626 | Whirlpool Corp | Morgan Stanley | (25.413) | 35.301 | WisdomTree Inc | HSBC | 9.355 |
| (219) | White Mountains Insurance Group Ltd | Bank of America | | 1.094 | Wix.com Ltd | Bank of America | |
| (616) | White Mountains Insurance Group Ltd | Merrill Lynch | 8.678 | | | Merrill Lynch | (2.694) |
| | | Barclays Bank | 4.278 | 2.799 | Wix.com Ltd | Barclays Bank | (8.733) |
| (663) | White Mountains Insurance Group Ltd | Barclays Bank | | 3.200 | Wix.com Ltd | Goldman Sachs | (7.744) |
| (175) | White Mountains Insurance Group Ltd | Goldman Sachs | 26.271 | 7.226 | Wix.com Ltd | HSBC | (15.391) |
| (384) | White Mountains Insurance Group Ltd | HSBC | 14.118 | 457 | Wix.com Ltd | Morgan Stanley | (1.426) |
| | | Morgan Stanley | 2.667 | (20.727) | Wolfspeed Inc | Barclays Bank | (46.325) |
| 7.932 | Whitestone (REIT) | HSBC | 1.348 | (8.095) | Wolfspeed Inc | Goldman Sachs | (53.467) |
| 17.636 | Whole Earth Brands Inc | Bank of America | | (586) | Wolfspeed Inc | HSBC | (1.311) |
| | | Merrill Lynch | 5.467 | (779) | Wolfspeed Inc | Morgan Stanley | (480) |
| 12.056 | Whole Earth Brands Inc | Barclays Bank | (2.652) | (53.401) | Wolverine World Wide Inc | Barclays Bank | 42.721 |
| 15.299 | Whole Earth Brands Inc | Goldman Sachs | 4.743 | (9.538) | Wolverine World Wide Inc | HSBC | 17.264 |
| 19.370 | Whole Earth Brands Inc | HSBC | 9.298 | (8.593) | Woodward Inc | Barclays Bank | 26.037 |
| 47.859 | Whole Earth Brands Inc | Morgan Stanley | (10.529) | (5.058) | Woodward Inc | Goldman Sachs | 11.431 |
| 19.645 | WideOpenWest Inc | Bank of America | | (8.381) | Woodward Inc | HSBC | 17.768 |
| | | Merrill Lynch | (8.447) | 3.537 | Workday Inc 'A' | HSBC | 103.457 |
| 15.664 | WideOpenWest Inc | Barclays Bank | (5.639) | (2.303) | Workday Inc 'A' | HSBC | (16.239) |
| 13.889 | WideOpenWest Inc | Goldman Sachs | (5.972) | (65.109) | Workhorse Group Inc | Barclays Bank | 4.369 |
| 8.801 | WideOpenWest Inc | HSBC | (6.161) | (25.782) | Workhorse Group Inc | Morgan Stanley | 1.730 |
| 14.254 | WideOpenWest Inc | Morgan Stanley | (5.131) | 3.343 | Workiva Inc | Bank of America | |
| (11.765) | Willdan Group Inc | Barclays Bank | 10.706 | | | Merrill Lynch | 18.503 |
| (1.473) | Willdan Group Inc | Goldman Sachs | 1.885 | 510 | Workiva Inc | Barclays Bank | 102 |
| 16.322 | Williams Cos Inc | Bank of America | | (466) | Workiva Inc | Barclays Bank | (93) |
| | | Merrill Lynch | (10.120) | 6.771 | Workiva Inc | Goldman Sachs | 44.020 |
| 106.549 | Williams Cos Inc | Barclays Bank | (79.912) | 525 | Workiva Inc | HSBC | 4.536 |
| 40.831 | Williams Cos Inc | Goldman Sachs | (25.315) | 5.319 | Workiva Inc | Morgan Stanley | 1.064 |
| 27.027 | Williams Cos Inc | HSBC | (29.189) | (309) | Workiva Inc | Morgan Stanley | 4 |
| 26.378 | Williams Cos Inc | Morgan Stanley | (19.784) | (1.415) | World Acceptance Corp | Barclays Bank | (2.731) |
| (503) | Williams-Sonoma Inc | Bank of America | | 3.028 | World Fuel Services Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 790 | | | Merrill Lynch | (999) |
| (413) | Williams-Sonoma Inc | Barclays Bank | (1.119) | 13.168 | World Fuel Services Corp | Barclays Bank | (7.111) |
| (844) | Williams-Sonoma Inc | HSBC | 1.410 | 24.212 | World Fuel Services Corp | Goldman Sachs | (7.990) |
| (2.502) | Williams-Sonoma Inc | Morgan Stanley | (6.780) | 16.343 | World Fuel Services Corp | HSBC | (5.720) |
| (297) | Willis Lease Finance Corp | Bank of America | | 21.565 | World Fuel Services Corp | Morgan Stanley | (11.645) |
| | | Merrill Lynch | 1.893 | 1.469 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Bank of America | |
| (2.791) | Willis Lease Finance Corp | Barclays Bank | 11.513 | 2.252 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Merrill Lynch | (8.483) |
| (1.905) | Willis Lease Finance Corp | Barclays Bank | 11.513 | | | Barclays Bank | (1.182) |
| (1.044) | Willis Lease Finance Corp | Goldman Sachs | 12.144 | 1.152 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Barclays Bank | (1.182) |
| (844) | Willis Towers Watson Plc | HSBC | 13.368 | | | Goldman Sachs | (6.653) |
| (1.035) | Willis Towers Watson Plc | Barclays Bank | 1.259 | 2.254 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | HSBC | (10.339) |
| (1.197) | Willis Towers Watson Plc | Goldman Sachs | 12.068 | | | HSBC | (10.339) |
| (8.575) | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | HSBC | 3.424 | 710 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Morgan Stanley | (207) |
| | | Barclays Bank | 2.144 | (12.024) | Worthington Industries Inc | Barclays Bank | 21.523 |
| 2.757 | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Barclays Bank | (689) | (3.897) | Worthington Industries Inc | Goldman Sachs | (1.364) |
| 5.675 | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Barclays Bank | (689) | (3.055) | Worthington Industries Inc | HSBC | 3.758 |
| 1.462 | Wingstop Inc | Morgan Stanley | (1.419) | (1.549) | Worthington Industries Inc | Morgan Stanley | 2.773 |
| | | Bank of America | | 2.058 | WP Carey Inc (REIT) | Bank of America | |
| 3.803 | Wingstop Inc | Merrill Lynch | (11.730) | | | Merrill Lynch | (2.755) |
| 3.916 | Wingstop Inc | Merrill Lynch | (11.730) | (3.421) | WP Carey Inc (REIT) | Barclays Bank | 2.121 |
| (373) | Wingstop Inc | Barclays Bank | (25.784) | 3.792 | WP Carey Inc (REIT) | Barclays Bank | (2.351) |
| (432) | Wingstop Inc | Goldman Sachs | (34.578) | 3.611 | WP Carey Inc (REIT) | Goldman Sachs | (8.108) |
| (183) | Wingstop Inc | Goldman Sachs | 3.294 | 12.848 | WP Carey Inc (REIT) | Goldman Sachs | (8.108) |
| 151 | Wingstop Inc | HSBC | 3.871 | 2.828 | WP Carey Inc (REIT) | HSBC | (46.208) |
| 368 | Winmark Corp | HSBC | 3.871 | (1.107) | WSFS Financial Corp | Morgan Stanley | (1.782) |
| | | Morgan Stanley | 1.241 | | | Bank of America | |
| 1.459 | Winmark Corp | Morgan Stanley | (755) | (2.692) | WSFS Financial Corp | Merrill Lynch | (2.613) |
| 711 | Winmark Corp | Bank of America | | (744) | WSFS Financial Corp | Barclays Bank | (242) |
| 827 | Winmark Corp | Merrill Lynch | 1.932 | 1.480 | WW Grainger Inc | HSBC | (1.696) |
| 1.720 | Winmark Corp | Barclays Bank | (6.420) | | | Bank of America | |
| 3.228 | Winnebago Industries Inc | Barclays Bank | (6.420) | 1.726 | WW Grainger Inc | Merrill Lynch | (29.986) |
| | | Goldman Sachs | 3.733 | 4.283 | WW Grainger Inc | Barclays Bank | (35.729) |
| | | HSBC | 3.515 | 2.920 | WW Grainger Inc | Goldman Sachs | (84.650) |
| | | Morgan Stanley | (7.568) | 3.321 | WW Grainger Inc | HSBC | (77.828) |
| | | Bank of America | | | | Morgan Stanley | (71.202) |
| | | Merrill Lynch | (807) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (12.536) | WW International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10.217 | (14.005) | Yellow Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.190 |
| (226) | WW International Inc | Goldman Sachs | 184 | (72.183) | Yellow Corp | Barclays Bank | 8.301 |
| (14.220) | WW International Inc | HSBC | 27.231 | (8.966) | Yellow Corp | Morgan Stanley | 1.031 |
| (12.340) | WW International Inc | Morgan Stanley | 13.142 | 16.862 | Yelp Inc | Barclays Bank | 15.176 |
| 18.182 | Wyndham Hotels & Resorts Inc | Barclays Bank | 43.637 | 16.013 | Yelp Inc | Goldman Sachs | 45.637 |
| 6.659 | Wyndham Hotels & Resorts Inc | HSBC | 3.196 | 19.398 | Yelp Inc | HSBC | 104.555 |
| 24.283 | Wyndham Hotels & Resorts Inc | HSBC | 3.196 | 7.846 | Yelp Inc | Morgan Stanley | 7.062 |
| 264 | Wynn Resorts Ltd | Morgan Stanley | 58.280 | (26.139) | YETI Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 132.928 |
| | | Bank of America Merrill Lynch | (956) | (16.559) | YETI Holdings Inc | Barclays Bank | 38.913 |
| 5.379 | Wynn Resorts Ltd | Barclays Bank | (49.503) | (2.783) | YETI Holdings Inc | Goldman Sachs | 14.667 |
| 915 | Wynn Resorts Ltd | HSBC | (3.509) | (11.422) | YETI Holdings Inc | HSBC | 84.409 |
| 1.861 | Wynn Resorts Ltd | Morgan Stanley | (13.658) | (16.708) | YETI Holdings Inc | Morgan Stanley | 39.264 |
| 4.091 | Xcel Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.836) | 6.593 | Yext Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8.043 |
| 16.961 | Xcel Energy Inc | Barclays Bank | (26.873) | 20.288 | Yext Inc | Barclays Bank | 12.376 |
| 30.752 | Xcel Energy Inc | Goldman Sachs | (111.322) | 4.891 | Yext Inc | Goldman Sachs | 5.967 |
| 9.669 | Xcel Energy Inc | HSBC | (18.573) | 6.059 | Yext Inc | HSBC | 6.725 |
| (20.571) | Xcel Energy Inc | HSBC | 103.472 | 4.176 | Yext Inc | Morgan Stanley | 2.547 |
| 25.139 | Xcel Energy Inc | Morgan Stanley | (39.971) | (10.867) | Y-mAbs Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 19.017 |
| (12.509) | Xcel Energy Inc | Morgan Stanley | 19.889 | (10.641) | Y-mAbs Therapeutics Inc | Barclays Bank | 11.279 |
| 4.310 | Xencor Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.922) | (1.980) | York Water Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.574 |
| 5.586 | Xencor Inc | Barclays Bank | (4.469) | (19.955) | York Water Co | Barclays Bank | 13.010 |
| 3.101 | Xencor Inc | Goldman Sachs | (2.822) | (1.418) | York Water Co | Goldman Sachs | 2.028 |
| 2.258 | Xencor Inc | Morgan Stanley | (1.806) | (8.823) | York Water Co | Morgan Stanley | 5.911 |
| (7.758) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 7.680 | 10.378 | Yum! Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (108.139) |
| (23.978) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Barclays Bank | 14.627 | (2.302) | Yum! Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 23.987 |
| (11.114) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | 11.003 | (6.535) | Yum! Brands Inc | Goldman Sachs | 68.095 |
| (3.919) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | HSBC | 3.684 | (568) | Yum! Brands Inc | HSBC | 5.209 |
| (7.976) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Morgan Stanley | 4.865 | (980) | Yum! Brands Inc | Morgan Stanley | 7.399 |
| 66.162 | Xeris Biopharma Holdings Inc | Barclays Bank | (21.172) | (862) | Zebra Technologies Corp 'A' | Barclays Bank | 14.982 |
| 10.616 | Xeris Biopharma Holdings Inc | HSBC | 2.442 | (3.742) | Zebra Technologies Corp 'A' | Goldman Sachs | 29.749 |
| 22.332 | Xerox Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (12.729) | (1.962) | Zebra Technologies Corp 'A' | HSBC | 28.915 |
| 30.513 | Xerox Holdings Corp | Barclays Bank | (24.716) | (1.376) | Zebra Technologies Corp 'A' | Morgan Stanley | 23.915 |
| 27.181 | Xerox Holdings Corp | Goldman Sachs | (15.493) | (1.560) | Zentalis Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 1.778 |
| 34.932 | Xerox Holdings Corp | Morgan Stanley | (28.295) | (5.438) | Zentalis Pharmaceuticals Inc | HSBC | (23.383) |
| (7.830) | XOMA Corp | Barclays Bank | 16.913 | (1.967) | Zentalis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 2.242 |
| (2.143) | XOMA Corp | Morgan Stanley | 4.629 | 9.040 | Zeta Global Holdings Corp 'A' | Barclays Bank | 689 |
| (1.438) | Xometry Inc 'A' | Barclays Bank | (1.927) | 19.377 | Zeta Global Holdings Corp 'A' | HSBC | 12.880 |
| (5.411) | Xometry Inc 'A' | HSBC | (29.869) | 18.350 | Zeta Global Holdings Corp 'A' | Morgan Stanley | 2.569 |
| (17.276) | Xometry Inc 'A' | Morgan Stanley | (23.150) | 3.874 | Zevia PBC 'A' | Barclays Bank | (2.479) |
| (3.817) | XPEL Inc | Barclays Bank | 23.894 | 5.210 | Zevia PBC 'A' | Goldman Sachs | (417) |
| (761) | XPEL Inc | HSBC | 1.590 | 8.919 | Zevia PBC 'A' | HSBC | 1.873 |
| (7.221) | Xperi Inc | Barclays Bank | (8.954) | 1.795 | Zevia PBC 'A' | Morgan Stanley | (1.149) |
| (5.750) | XPO Inc | Bank of America Merrill Lynch | (288) | (10.099) | Zevra Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (6.564) |
| (12.826) | XPO Inc | Barclays Bank | (3.499) | (6.894) | Zevra Therapeutics Inc | HSBC | (620) |
| (18.900) | XPO Inc | Goldman Sachs | (945) | (6.445) | Zevra Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 4.060 |
| (10.540) | XPO Inc | HSBC | 8.643 | (2.311) | Ziff Davis Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12.156 |
| (2.341) | Xponential Fitness Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 7.491 | (4.316) | Ziff Davis Inc | Barclays Bank | 26.198 |
| (4.315) | Xponential Fitness Inc 'A' | Barclays Bank | 6.559 | (7.689) | Ziff Davis Inc | Goldman Sachs | 40.444 |
| (9.516) | Xponential Fitness Inc 'A' | HSBC | 26.264 | (22.768) | Ziff Davis Inc | HSBC | 158.465 |
| 25.014 | Xylem Inc | Barclays Bank | (87.743) | (6.776) | Ziff Davis Inc | Morgan Stanley | 41.130 |
| 8.398 | Xylem Inc | Goldman Sachs | (33.424) | 700 | Ziff Davis Inc | Morgan Stanley | (4.249) |
| 19.894 | Xylem Inc | HSBC | (132.892) | 1.288 | Zillow Group Inc 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (131) |
| 22.071 | Xylem Inc | Morgan Stanley | (81.221) | 984 | Zillow Group Inc 'C' | Barclays Bank | (118) |
| | | | | 2.003 | Zillow Group Inc 'C' | Goldman Sachs | (235) |
| | | | | 2.866 | Zillow Group Inc 'C' | Morgan Stanley | (344) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (333) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Barclays Bank | 3.440 |
| (4.707) | Zimvie Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.212 |
| (5.704) | Zions Bancorp NA | Bank of America Merrill Lynch | 1.712 |
| (2.426) | Zions Bancorp NA | Goldman Sachs | (593) |
| 9.227 | Zions Bancorp NA | Morgan Stanley | 2.214 |
| (4.190) | Zions Bancorp NA | Morgan Stanley | (1.006) |
| 4.137 | ZipRecruiter Inc 'A' | HSBC | (7.281) |
| 11.720 | ZipRecruiter Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.977) |
| (4.997) | Zoetis Inc | Bank of America Merrill Lynch | 120.178 |
| (5.263) | Zoetis Inc | Barclays Bank | 103.786 |
| (262) | Zoetis Inc | Goldman Sachs | 5.670 |
| (1.945) | Zoetis Inc | HSBC | 49.271 |
| (18.754) | Zoetis Inc | Morgan Stanley | 369.829 |
| 10.869 | Zoom Video Communications Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.935) |
| 15.812 | Zoom Video Communications Inc 'A' | Barclays Bank | (89.338) |
| 7.835 | Zoom Video Communications Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.115) |
| 13.646 | Zoom Video Communications Inc 'A' | Morgan Stanley | (77.100) |
| 3.367 | ZoomInfo Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10.825 |
| 3.344 | ZoomInfo Technologies Inc | Barclays Bank | (886) |
| 5.856 | ZoomInfo Technologies Inc | HSBC | 18.784 |
| 6.316 | ZoomInfo Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.674) |
| (672) | Zscaler Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.575) |
| (943) | Zscaler Inc | Barclays Bank | (5.507) |
| (2.228) | Zscaler Inc | Goldman Sachs | (18.383) |
| (1.377) | Zscaler Inc | Morgan Stanley | (8.041) |
| 17.478 | Zumiez Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.107) |
| 3.025 | Zumiez Inc | Barclays Bank | (1.013) |
| 1.517 | Zumiez Inc | Goldman Sachs | (356) |
| 3.029 | Zumiez Inc | HSBC | (1.681) |
| 13.294 | Zumiez Inc | Morgan Stanley | (4.453) |
| 33.057 | Zuora Inc 'A' | Barclays Bank | 58.841 |
| 41.371 | Zuora Inc 'A' | HSBC | 108.392 |
| (35.152) | Zurm Elkay Water Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | (28.121) |
| (79.051) | Zurm Elkay Water Solutions Corp | Barclays Bank | 31.620 |
| (5.425) | Zurm Elkay Water Solutions Corp | Goldman Sachs | (4.340) |
| (22.762) | Zurm Elkay Water Solutions Corp | HSBC | (18.893) |
| (27.921) | Zurm Elkay Water Solutions Corp | Morgan Stanley | 11.169 |
| 4.130 | Zymeworks Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.897) |
| 9.980 | Zymeworks Inc | Barclays Bank | (10.379) |
| 2.869 | Zymeworks Inc | HSBC | (1.750) |
| (12) | Zynerba Pharmaceuticals Inc [†] | HSBC | — |
| 7.823 | Zynex Inc | Barclays Bank | (3.677) |
| 3.263 | Zynex Inc | Goldman Sachs | (1.044) |
| | | | (5.925.783) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 4.478.898.269) | | | (6.269.802) |

[†] Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a).

^{††} Beträge mit einem Wert unter USD 0,5 wurden auf null abgerundet.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|----------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 244.842 | USD | 276.066 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (7.395) |
| USD | 4.780 | CHF | 4.271 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 94 |
| | | | | | | (7.301) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 266.007.355 | USD | 294.373.775 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (10.130.654) |
| USD | 25.865.638 | EUR | 23.864.187 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 365.478 |
| | | | | | | (9.765.176) |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 2.565 | USD | 3.210 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (34) |
| USD | 3.019 | GBP | 2.410 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 35 |
| | | | | | | 1 |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| JPY | 39.840.460.329 | USD | 296.191.884 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (11.390.597) |
| USD | 5.186.771 | JPY | 702.888.538 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 162.141 |
| | | | | | | (11.228.456) |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SEK | 623.645.964 | USD | 58.520.001 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.104.709) |
| USD | 5.974.581 | SEK | 63.453.894 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 132.766 |
| | | | | | | (971.943) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 663.105.826) | | | | | | (21.972.875) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 52,12 |
| Staatsanleihen | 38,73 |
| Industrie | 5,22 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 4,72 |
| Kommunikation | 2,16 |
| Grundstoffe | 1,08 |
| Zyklische Konsumgüter | 1,01 |
| Technologie | 0,01 |
| Diversifiziert | 0,00 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 105,05 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (5,05) |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|--|-----------------------|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIE | | | | | | | |
| Bermuda | | | | | | | |
| 1.473.400 | China Gas Holdings Ltd | 1.670.140 | 2,21 | | | | |
| 1.842.000 | Shangri-La Asia Ltd | 1.377.864 | 1,82 | | | | |
| | | 3.048.004 | 4,03 | | | | |
| Kaimaninseln | | | | | | | |
| 12.790 | Baidu Inc ADR | 1.555.392 | 2,06 | | | | |
| 295.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | 1.786.063 | 2,36 | | | | |
| 97.513 | KE Holdings Inc ADR* | 1.386.147 | 1,84 | | | | |
| 227.500 | Li Ning Co Ltd | 1.219.691 | 1,61 | | | | |
| | | 5.947.293 | 7,87 | | | | |
| China | | | | | | | |
| 101.920 | Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'A' | 1.884.059 | 2,49 | | | | |
| 1.020.000 | China Life Insurance Co Ltd 'H' | 1.721.277 | 2,28 | | | | |
| 1.722.000 | China Oilfield Services Ltd 'H' | 1.754.104 | 2,32 | | | | |
| 133.800 | Ganfeng Lithium Group Co Ltd 'H' | 846.289 | 1,12 | | | | |
| 2.740.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' | 1.465.493 | 1,94 | | | | |
| | | 7.671.222 | 10,15 | | | | |
| Hongkong | | | | | | | |
| 171.200 | AIA Group Ltd | 1.641.205 | 2,17 | | | | |
| 282.000 | China Resources Beer Holdings Co Ltd | 1.778.260 | 2,35 | | | | |
| 1.940.000 | Guangdong Investment Ltd | 1.651.759 | 2,19 | | | | |
| 325.500 | Link (REIT) | 1.890.522 | 2,50 | | | | |
| | | 6.961.746 | 9,21 | | | | |
| Indien | | | | | | | |
| 159.002 | Godrej Consumer Products Ltd | 2.040.764 | 2,70 | | | | |
| 74.078 | HDFC Bank Ltd | 1.442.666 | 1,91 | | | | |
| 122.805 | Mahindra & Mahindra Ltd | 1.953.732 | 2,58 | | | | |
| 156.677 | PB Fintech Ltd | 1.146.975 | 1,52 | | | | |
| 110.070 | SBI Cards & Payment Services Ltd | 1.229.328 | 1,62 | | | | |
| | | 7.813.465 | 10,33 | | | | |
| Indonesien | | | | | | | |
| 7.272.400 | Astra International Tbk PT | 3.129.218 | 4,14 | | | | |
| 3.717.500 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | 2.244.388 | 2,97 | | | | |
| | | 5.373.606 | 7,11 | | | | |
| Philippinen | | | | | | | |
| 5.313.800 | Bloomerry Resorts Corp | 972.683 | 1,29 | | | | |
| 317.420 | Jollibee Foods Corp | 1.331.626 | 1,76 | | | | |
| | | 2.304.309 | 3,05 | | | | |
| Südkorea | | | | | | | |
| 5.558 | Hansol Chemical Co Ltd | 969.431 | 1,28 | | | | |
| 44.377 | Hanwha Solutions Corp | 1.496.229 | 1,98 | | | | |
| 20.828 | JYP Entertainment Corp | 1.914.497 | 2,53 | | | | |
| 130.540 | Lotte Tour Development Co Ltd | 1.086.809 | 1,44 | | | | |
| 17.792 | Orion Corp | 1.731.947 | 2,29 | | | | |
| 38.851 | Samsung Electronics Co Ltd | 2.090.007 | 2,76 | | | | |
| 31.970 | S-Oil Corp | 1.739.110 | 2,30 | | | | |
| | | 11.028.030 | 14,58 | | | | |
| Taiwan | | | | | | | |
| 65.000 | Lotes Co Ltd | 1.842.486 | 2,44 | | | | |
| 235.000 | Unimicron Technology Corp | 1.380.441 | 1,82 | | | | |
| 709.000 | United Microelectronics Corp | 1.195.223 | 1,58 | | | | |
| | | 4.418.150 | 5,84 | | | | |
| | | | | Thailand | | | |
| 375.300 | Bangkok Bank PCL NVDR | 1.757.871 | 2,32 | | | | |
| 199.200 | Siam Cement PCL NVDR | 1.826.000 | 2,42 | | | | |
| | | 3.583.871 | 4,74 | | | | |
| Gesamt Stammaktien | | | | 58.149.696 | | 76,91 | |
| | | | | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 3.150.000 | Atlantic Asset Securitization LLC 28/7/2023 (Zero Coupon) | 3.123.466 | 4,13 | | | | |
| USD 3.825.000 | John Deere Capital Corp 22/6/2023 (Zero Coupon) | 3.813.844 | 5,04 | | | | |
| | | 6.937.310 | 9,17 | | | | |
| Gesamt kurzfristige Titel | | | | 6.937.310 | | 9,17 | |
| | | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| | | | | 65.087.006 | | 86,08 | |
| | | | | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | | | | Irland | | | |
| 68.080 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist)* | 6.809.791 | 9,01 | | | | |
| | | 6.809.791 | 9,01 | | | | |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | 6.809.791 | | 9,01 | |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | | 71.896.797 | | 95,09 | |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | | 3.712.221 | | 4,91 | |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | | 75.609.018 | | 100,00 | |
| | | | | * Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| | | | | - Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|---|----------------------------------|---|---|---|----------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (34.419) | Kakao Corp | JP Morgan | 46.058 |
| Australien | | | | (2.414) | LG H&H Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 67.114 |
| (104.163) | Fortescue Metals Group Ltd | Morgan Stanley | 125.663 | (415) | LG H&H Co Ltd | JP Morgan | 19.639 |
| (578.680) | Pilbara Minerals Ltd | Morgan Stanley | 195.756 | (5.929) | POSCO Future M Co Ltd | JP Morgan | (114.197) |
| | | | 321.419 | | | | (217.037) |
| Kaimaninseln | | | | Taiwan | | | |
| (195.717) | NIO Inc ADR | Morgan Stanley | 299.447 | (1.588.000) | Acer Inc | JP Morgan | (96.535) |
| | | | 299.447 | (1.062.000) | Asia Cement Corp | Morgan Stanley | 17.307 |
| Hongkong | | | | (790.000) | China Steel Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.753 |
| 216.400 | Alibaba Group Holding Ltd | Morgan Stanley | (159.253) | (602.000) | Fubon Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (24.124) |
| (1.886.000) | Alibaba Health Information Technology Ltd | Morgan Stanley | 63.513 | (95.000) | Great Tree Pharmacy Co Ltd | JP Morgan | 213.252 |
| (138.400) | ANTA Sports Products Ltd | Morgan Stanley | 141.661 | (61.000) | MediaTek Inc | Morgan Stanley | (104.871) |
| (242.400) | China Literature Ltd | Morgan Stanley | 69.814 | (30.000) | Parade Technologies Ltd | Morgan Stanley | (86.359) |
| 720.000 | China Mengniu Dairy Co Ltd | Morgan Stanley | (94.158) | | | | (79.577) |
| (1.281.000) | China Railway Group Ltd 'H' | JP Morgan | 153.618 | Thailand | | | |
| (55.500) | China Tourism Group Duty Free Corp Ltd 'H' | JP Morgan | 199.330 | (85.200) | Berli Jucker PCL NVDR | Morgan Stanley | 74 |
| (118.600) | Hang Seng Bank Ltd | JP Morgan | 154.439 | (756.600) | Central Retail Corp PCL NVDR | Bank of America Merrill Lynch | 100.216 |
| (188.500) | Hengan International Group Co Ltd | Morgan Stanley | 63.234 | (488.500) | Energy Absolute PCL NVDR | Morgan Stanley | 26.928 |
| (35.700) | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 121.283 | | | | 127.218 |
| (692.000) | Jiumaojiu International Holdings Ltd | JP Morgan | 167.264 | Großbritannien | | | |
| (175.300) | Kuaishou Technology | Morgan Stanley | 12.121 | (21.084) | State Bank of India Reg GDR | Bank of America Merrill Lynch | 18.975 |
| 10.600 | Kweichow Moutai Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (190.462) | | | | 18.975 |
| (261.100) | New China Life Insurance Co Ltd 'H' | Morgan Stanley | 33.117 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| (103.000) | Orient Overseas International Ltd | JP Morgan | 729.709 | (47.373) | Coupage Inc | JP Morgan | 110.379 |
| (1.022.000) | PICC Property & Casualty Co Ltd 'H' | Goldman Sachs | 85.974 | (11.892) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | JP Morgan | 236.651 |
| 53.800 | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (126.102) | (11.735) | ON Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (15.784) |
| (533.800) | Swire Properties Ltd | Morgan Stanley | 102.596 | (167.247) | ReNew Energy Global Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 30.105 |
| (961.200) | Xiaomi Corp 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 94.894 | | | | 361.351 |
| (357.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 78.933 | Vietnam | | | |
| (344.000) | Yadea Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | 66.453 | 569.400 | Mobile World Investment Corp | JP Morgan | 31.383 |
| (458.000) | Yankuang Energy Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | 474.236 | 1.999.800 | PetroVietnam Drilling & Well Services JSC | Morgan Stanley | 46.817 |
| | | | 2.242.214 | | | | 78.200 |
| Indonesien | | | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 63.923.889) | | | |
| (6.428.500) | Adaro Energy Indonesia Tbk PT | JP Morgan | 382.367 | | | | 3.572.122 |
| | | | 382.367 | Philippinen | | | |
| Philippinen | | | | Südkorea | | | |
| (538.800) | SM Prime Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.352 | (17.076) | CS Wind Corp | Bank of America Merrill Lynch | (15.000) |
| (1.722.500) | SM Prime Holdings Inc | JP Morgan | 34.193 | (845) | Ecopro BM Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (975) |
| | | | 37.545 | (7.185) | Ecopro BM Co Ltd | Goldman Sachs | (146.776) |
| | | | | (990.860) | Hanwha Life Insurance Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (72.900) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|----------------------------------|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (540) | USD | FTSE China A50 Futures June 2023 | Juni 2023 | 6.620.940 | 172.621 |
| (246) | USD | SGX NIFTY 50 Futures June 2023 | Juni 2023 | 9.182.688 | (140.525) |
| Gesamt | | | | | 32.096 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 5.473 | USD | 6.179 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (174) |
| USD | 39 | CHF | 35 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1 |
| | | | | | | (173) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 16.082.398 | USD | 17.770.791 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (585.888) |
| USD | 140.177 | EUR | 129.459 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1.845 |
| | | | | | | (584.043) |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 967.573 | USD | 1.223.977 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (25.888) |
| USD | 7.827 | GBP | 6.290 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 39 |
| | | | | | | (25.849) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 18.535.158) | | | | | | (610.065) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 23,68 |
| Zyklische Konsumgüter | 17,17 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 12,19 |
| Industrie | 9,30 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 9,01 |
| Technologie | 5,86 |
| Energie | 4,62 |
| Versorger | 4,40 |
| Grundstoffe | 4,38 |
| Diversifiziert | 2,42 |
| Kommunikation | 2,06 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 95,09 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 4,91 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Indien Fortsetzung | | | |
| | | | | 2.751 | Zensar Technologies Ltd | 12.343 | 0,03 |
| | | | | 2.330 | Zydus Lifesciences Ltd | 14.137 | 0,03 |
| | | | | | | 1.358.407 | 3,12 |
| | | | | | Gesamt Stammaktien | 2.762.636 | 6,34 |
| STAMMAKTIEN | | | | ANLEIHEN | | | |
| | China | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 1.100 | Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'A' | 38.867 | 0,09 | USD 500.000 | Federal Farm Credit Discount Notes 5/10/2023 (Zero Coupon) | 491.215 | 1,13 |
| 300 | Anjoy Foods Group Co Ltd 'A' | 6.485 | 0,01 | USD 1.850.000 | Federal Home Loan Bank Discount Notes 20/6/2023 (Zero Coupon) | 1.845.187 | 4,24 |
| 11.335 | BYD Co Ltd 'A' | 403.267 | 0,93 | USD 500.000 | Federal Home Loan Bank Discount Notes 28/2/2024 (Zero Coupon) | 482.042 | 1,11 |
| 12.240 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd 'A' | 379.688 | 0,87 | USD 950.000 | United States Treasury Bill 29/8/2023 (Zero Coupon) | 938.205 | 2,15 |
| 6.900 | Dong-E-E-Jiao Co Ltd 'A' | 47.778 | 0,11 | USD 1.000.000 | United States Treasury Bill 7/9/2023 (Zero Coupon) | 986.933 | 2,27 |
| 7.224 | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A' | 33.416 | 0,08 | USD 1.000.000 | United States Treasury Bill 14/9/2023 (Zero Coupon) | 986.321 | 2,26 |
| 12.896 | Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd 'A' | 23.116 | 0,05 | USD 2.000.000 | United States Treasury Bill 19/9/2023 (Zero Coupon) | 1.968.097 | 4,52 |
| 4.300 | Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd 'A' | 80.960 | 0,19 | USD 1.800.000 | United States Treasury Bill 26/9/2023 (Zero Coupon) | 1.769.267 | 4,06 |
| 1.795 | Luzhou Laojiao Co Ltd 'A' | 51.366 | 0,12 | USD 2.000.000 | United States Treasury Bill 5/10/2023 (Zero Coupon) | 1.967.838 | 4,52 |
| 3.700 | SF Holding Co Ltd 'A' | 24.562 | 0,06 | USD 3.100.000 | United States Treasury Bill 12/10/2023 (Zero Coupon) | 3.044.192 | 6,99 |
| 8.600 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd 'A' | 71.274 | 0,16 | USD 1.100.000 | United States Treasury Bill 30/11/2023 (Zero Coupon) | 1.074.905 | 2,47 |
| 2.900 | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd 'A' | 122.258 | 0,28 | USD 285.000 | United States Treasury Bill 18/4/2024 (Zero Coupon) | 273.452 | 0,63 |
| 15.200 | Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 66.024 | 0,15 | USD 250.000 | United States Treasury Bill 16/5/2024 (Zero Coupon) | 238.794 | 0,55 |
| 11.500 | Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd 'A' | 40.985 | 0,09 | USD 1.400.000 | United States Treasury Floating Rate Note FRN 31/10/2023 | 1.400.076 | 3,21 |
| 640 | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd 'A' | 14.183 | 0,03 | USD 200.000 | United States Treasury Note/Bond 0,875% 31/1/2024 | 194.217 | 0,45 |
| | | 1.404.229 | 3,22 | USD 500.000 | United States Treasury Note/Bond 2,25% 31/3/2024 | 487.754 | 1,12 |
| | | | | | | 18.148.495 | 41,68 |
| | Indien | | | | | 18.148.495 | 41,68 |
| 1.086 | ABB India Ltd | 56.378 | 0,13 | EINLAGENZERTIFIKATE | | | |
| 325 | Apar Industries Ltd | 10.980 | 0,02 | Kanada | | | |
| 4.321 | APL Apollo Tubes Ltd | 58.914 | 0,14 | USD 350.000 | Royal Bank of Canada FRN 26/4/2024 | 350.000 | 0,80 |
| 38.899 | Ashok Leyland Ltd | 68.858 | 0,16 | USD 250.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 29/1/2024 | 250.000 | 0,58 |
| 39 | Bajaj Finance Ltd | 3.288 | 0,01 | | | 600.000 | 1,38 |
| 3.523 | CG Power & Industrial Solutions Ltd | 16.607 | 0,04 | Frankreich | | | |
| 4.867 | Cummins India Ltd | 103.332 | 0,24 | USD 300.000 | BNP Paribas SA FRN 16/11/2023 | 300.000 | 0,69 |
| 141 | Dalmia Bharat Ltd | 3.639 | 0,01 | USD 250.000 | Credit Industriel Et Commercial SA FRN 10/7/2023 | 250.011 | 0,57 |
| 26.676 | Federal Bank Ltd | 40.353 | 0,09 | | | 550.011 | 1,26 |
| 16.228 | GMR Airports Infrastructure Ltd | 7.974 | 0,02 | Japan | | | |
| 2.977 | Great Eastern Shipping Co Ltd | 24.719 | 0,06 | USD 250.000 | Mizuho Bank Ltd FRN 21/2/2024 | 250.000 | 0,58 |
| 8.547 | Hindustan Petroleum Corp Ltd | 27.134 | 0,06 | | | 250.000 | 0,58 |
| 8.959 | Indian Hotels Co Ltd | 42.125 | 0,10 | | | | |
| 7.265 | Jindal Stainless Ltd | 26.423 | 0,06 | | | | |
| 2.137 | KPIT Technologies Ltd | 27.482 | 0,06 | | | | |
| 1.699 | Lemon Tree Hotels Ltd | 1.982 | 0,00 | | | | |
| 16.751 | Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd | 57.806 | 0,13 | | | | |
| 1.650 | Mahindra & Mahindra Ltd | 26.250 | 0,06 | | | | |
| 16.414 | Manappuram Finance Ltd | 21.844 | 0,05 | | | | |
| 21 | MRF Ltd | 24.657 | 0,06 | | | | |
| 22.498 | Oil & Natural Gas Corp Ltd | 41.797 | 0,10 | | | | |
| 5.681 | Oil India Ltd | 17.709 | 0,04 | | | | |
| 1.087 | One 97 Communications Ltd | 9.156 | 0,02 | | | | |
| 1.961 | PI Industries Ltd | 86.041 | 0,20 | | | | |
| 36 | Polycab India Ltd | 1.490 | 0,00 | | | | |
| 69.000 | Power Finance Corp Ltd | 151.917 | 0,35 | | | | |
| 69.460 | REC Ltd | 118.716 | 0,27 | | | | |
| 4.440 | State Bank of India | 31.181 | 0,07 | | | | |
| 797 | Tata Consultancy Services Ltd | 31.656 | 0,07 | | | | |
| 3.892 | TVS Motor Co Ltd | 60.496 | 0,14 | | | | |
| 5.994 | Varun Beverages Ltd | 122.261 | 0,28 | | | | |
| 882 | Voltas Ltd | 8.762 | 0,02 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|----------------------------|--|------------------------|--------------------|-------------|--|------------------------|--------------------|
| | Großbritannien | | | | Schweden Fortsetzung | | |
| USD 350.000 | Oversea Chinese Banking Corporation FRN 14/7/2023 | 350.012 | 0,80 | USD 250.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 28/7/2023 | 250.000 | 0,57 |
| | | 350.012 | 0,80 | | | 797.565 | 1,83 |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | | | Großbritannien | | |
| USD 225.000 | Bank of America NA FRN 14/7/2023 | 225.000 | 0,52 | USD 600.000 | Lloyds Bank Plc 2/8/2023 (Zero Coupon) | 594.833 | 1,37 |
| USD 250.000 | Natixis SA FRN 2/2/2024 | 250.000 | 0,57 | | | 594.833 | 1,37 |
| | | 475.000 | 1,09 | | Vereinigte Staaten von Amerika | | |
| Gesamt Einlagenzertifikate | | 2.225.023 | 5,11 | USD 350.000 | Alinghi Funding Co LLC 13/7/2023 (Zero Coupon) | 347.930 | 0,80 |
| KURZFRISTIGE TITEL | | | | USD 250.000 | Amazon.com Inc 28/6/2023 (Zero Coupon) | 249.100 | 0,57 |
| | Australien | | | USD 500.000 | Amazon.com Inc 17/7/2023 (Zero Coupon) | 496.882 | 1,14 |
| USD 250.000 | Commonwealth Bank of Australia FRN 16/2/2024 | 250.000 | 0,58 | USD 250.000 | Barton Capital SA 13/6/2023 (Zero Coupon) | 249.571 | 0,57 |
| USD 500.000 | National Australia Bank Ltd 1/6/2023 (Zero Coupon) | 500.000 | 1,15 | USD 250.000 | Charta LLC 16/6/2023 (Zero Coupon) | 249.485 | 0,57 |
| USD 250.000 | National Australia Bank Ltd 12/6/2023 (Zero Coupon) | 249.733 | 0,57 | USD 375.000 | Ciesco LLC 5/6/2023 (Zero Coupon) | 374.788 | 0,86 |
| USD 250.000 | Westpac Banking Corp 30/8/2023 (Zero Coupon) | 247.456 | 0,57 | USD 250.000 | Cooperatieve Rabobank UA 25/9/2023 (Zero Coupon) | 246.004 | 0,57 |
| | | 1.247.189 | 2,87 | USD 450.000 | Cooperatieve Rabobank UA 2/10/2023 (Zero Coupon) | 442.497 | 1,02 |
| | Kanada | | | USD 500.000 | Florida Power & Light Co 5/6/2023 (Zero Coupon) | 499.720 | 1,15 |
| USD 250.000 | Bank of Montreal FRN 6/10/2023 | 249.860 | 0,57 | USD 250.000 | GTA Funding LLC 10/7/2023 (Zero Coupon) | 248.608 | 0,57 |
| USD 250.000 | CDP Financial Inc 1/11/2023 (Zero Coupon) | 244.719 | 0,56 | USD 500.000 | GTA Funding LLC 4/8/2023 (Zero Coupon) | 495.360 | 1,14 |
| USD 500.000 | Export Development Canada 9/6/2023 (Zero Coupon) | 499.478 | 1,15 | USD 500.000 | ING US Funding LLC 1/9/2023 (Zero Coupon) | 493.777 | 1,13 |
| USD 350.000 | National Bank of Canada 14/7/2023 (Zero Coupon) | 347.849 | 0,80 | USD 250.000 | ING US Funding LLC 25/9/2023 (Zero Coupon) | 246.021 | 0,57 |
| USD 250.000 | Podium Funding Trust 25/7/2023 (Zero Coupon) | 248.136 | 0,57 | USD 350.000 | John Deere Capital Corp 22/6/2023 (Zero Coupon) | 348.979 | 0,80 |
| USD 250.000 | Podium Funding Trust 1/11/2023 (Zero Coupon) | 244.369 | 0,56 | USD 500.000 | John Deere Capital Corp 7/8/2023 (Zero Coupon) | 495.236 | 1,14 |
| | | 1.834.411 | 4,21 | USD 425.000 | Johnson & Johnson 13/7/2023 (Zero Coupon) | 422.610 | 0,97 |
| | Frankreich | | | USD 250.000 | Koch Industries Inc 28/6/2023 (Zero Coupon) | 249.051 | 0,57 |
| USD 250.000 | Antalis SA 1/8/2023 (Zero Coupon) | 247.894 | 0,57 | USD 400.000 | Linde Plc 5/7/2023 (Zero Coupon) | 398.085 | 0,91 |
| USD 400.000 | BPCE SA 1/8/2023 (Zero Coupon) | 396.652 | 0,91 | USD 500.000 | L'Oreal SA 24/8/2023 (Zero Coupon) | 493.922 | 1,14 |
| | | 644.546 | 1,48 | USD 250.000 | Mackinac Funding Co LLC 7/6/2023 (Zero Coupon) | 249.786 | 0,57 |
| | Luxemburg | | | USD 250.000 | Macquarie Bank Ltd FRN 22/6/2023 | 250.000 | 0,57 |
| USD 500.000 | Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 23/6/2023 (Zero Coupon) | 498.457 | 1,14 | USD 400.000 | Niederlandse Waterschapsbank NV 1/6/2023 (Zero Coupon) | 400.000 | 0,92 |
| USD 350.000 | Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 11/8/2023 (Zero Coupon) | 346.700 | 0,80 | USD 650.000 | Niederlandse Waterschapsbank NV 13/6/2023 (Zero Coupon) | 648.964 | 1,49 |
| | | 845.157 | 1,94 | USD 250.000 | Niederlandse Waterschapsbank NV 19/7/2023 (Zero Coupon) | 248.300 | 0,57 |
| | Südafrika | | | USD 500.000 | Nestle Finance International Ltd 29/9/2023 (Zero Coupon) | 491.500 | 1,13 |
| USD 400.000 | KFW International Finance Inc 20/7/2023 (Zero Coupon) | 397.278 | 0,91 | USD 500.000 | Oesterreichische Kontrollbank AG 26/6/2023 (Zero Coupon) | 498.240 | 1,15 |
| | | 397.278 | 0,91 | USD 250.000 | Old Line Funding LLC 11/7/2023 (Zero Coupon) | 248.625 | 0,57 |
| | Spanien | | | | | | |
| USD 250.000 | Banco Santander SA 4/10/2023 (Zero Coupon) | 245.521 | 0,56 | | | | |
| | | 245.521 | 0,56 | | | | |
| | Schweden | | | | | | |
| USD 250.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 10/8/2023 (Zero Coupon) | 247.565 | 0,57 | | | | |
| USD 300.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 13/7/2023 | 300.000 | 0,69 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 1.000.000 | Old Line Funding LLC 4/12/2023 (Zero Coupon) | 971.377 | 2,23 |
| USD 400.000 | Pacific Life Insurance Co 21/6/2023 (Zero Coupon) | 398.858 | 0,92 |
| USD 250.000 | Pure Grove Funding 14/11/2023 (Zero Coupon) | 243.879 | 0,56 |
| USD 400.000 | Siemens Capital Co LLC 30/6/2023 (Zero Coupon) | 398.395 | 0,92 |
| USD 250.000 | Societe Generale SA FRN 17/11/2023 | 250.000 | 0,57 |
| USD 250.000 | Suncorp Metway Ltd 6/6/2023 (Zero Coupon) | 249.831 | 0,57 |
| USD 500.000 | United Overseas Bank Ltd 28/7/2023 (Zero Coupon) | 495.883 | 1,14 |
| | | 13.091.264 | 30,07 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 19.697.764 | 45,24 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 42.833.918 | 98,37 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 42.833.918 | 98,37 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 708.526 | 1,63 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 43.542.444 | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------|---|-------------------------------|---|-------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | | | | |
| Australien | | | | | | | |
| 20.013 | 29Metals Ltd | Citibank | (4.586) | 5.600 | Auckland International Airport Ltd | JP Morgan | (1.130) |
| 20.516 | 29Metals Ltd | HSBC | (7.874) | (8.711) | Aurizon Holdings Ltd | HSBC | 515 |
| 7.017 | 29Metals Ltd | JP Morgan | (2.780) | (10.194) | Aurizon Holdings Ltd | JP Morgan | 445 |
| 9.165 | 5E Advanced Materials Inc - CDI | HSBC | (1.800) | (27.182) | Aussie Broadband Ltd | Citibank | 2.978 |
| 14.554 | 5E Advanced Materials Inc - CDI | JP Morgan | (2.811) | (9.179) | Aussie Broadband Ltd | JP Morgan | 2.467 |
| 6.776 | Abacus Property Group (REIT) | Citibank | (261) | (8.085) | Australian Agricultural Co Ltd | Citibank | (40) |
| 1.817 | Abacus Property Group (REIT) | HSBC | (343) | (17.521) | Australian Agricultural Co Ltd | HSBC | 576 |
| (9.521) | Abacus Property Group (REIT) | HSBC | 1.797 | (31.962) | Australian Agricultural Co Ltd | JP Morgan | 241 |
| 6.258 | Abacus Property Group (REIT) | JP Morgan | (1.099) | 6.035 | Australian Ethical Investment Ltd | Citibank | (1.213) |
| (4.557) | Abacus Property Group (REIT) | JP Morgan | 777 | 2.518 | Australian Ethical Investment Ltd | HSBC | (1.024) |
| 15.875 | Accent Group Ltd | Citibank | (5.652) | (4.899) | Bapcor Ltd | JP Morgan | 2.019 |
| 18.137 | Accent Group Ltd | HSBC | (10.548) | 11.518 | Beach Energy Ltd | Citibank | (287) |
| 26.922 | Accent Group Ltd | JP Morgan | (15.327) | (16.594) | Beach Energy Ltd | HSBC | 1.395 |
| (12.672) | Adairs Ltd | Citibank | 3.151 | 25.160 | Beach Energy Ltd | JP Morgan | (1.939) |
| (7.501) | Adairs Ltd | JP Morgan | 2.046 | (70.971) | Beach Energy Ltd | JP Morgan | 5.471 |
| (2.517) | Allkem Ltd | HSBC | (2.886) | (8.568) | Bega Cheese Ltd | JP Morgan | 2.373 |
| (2.102) | Allkem Ltd | JP Morgan | (2.536) | (46.872) | Bellevue Gold Ltd | HSBC | 3.352 |
| 1.368 | ALS Ltd | Citibank | (972) | (13.296) | Bellevue Gold Ltd | JP Morgan | 766 |
| 5.548 | ALS Ltd | HSBC | (5.799) | (799) | Blackmores Ltd | HSBC | 2.336 |
| 1.724 | ALS Ltd | JP Morgan | (1.204) | (445) | Blackmores Ltd | JP Morgan | 1.082 |
| 14.710 | Alumina Ltd | HSBC | (706) | 65 | Block Inc - CDI | Citibank | 1 |
| (14.421) | AMP Ltd | HSBC | 835 | 406 | Block Inc - CDI | HSBC | (549) |
| (54.447) | AMP Ltd | JP Morgan | 2.856 | 512 | Block Inc - CDI | JP Morgan | (463) |
| 1.752 | Ampol Ltd | Citibank | (472) | 10.667 | Boral Ltd | Citibank | (662) |
| 2.812 | Ampol Ltd | HSBC | 342 | 2.152 | Boral Ltd | HSBC | (246) |
| 294 | Ampol Ltd | JP Morgan | 78 | 14.386 | Boral Ltd | JP Morgan | (1.497) |
| 927 | Ansell Ltd | Citibank | (295) | (35.645) | Boss Energy Ltd | Citibank | 1.519 |
| 1.854 | Ansell Ltd | HSBC | (1.874) | (9.239) | Boss Energy Ltd | JP Morgan | 402 |
| 796 | Ansell Ltd | JP Morgan | (473) | (445) | Breville Group Ltd | Citibank | 399 |
| 2.527 | ANZ Group Holdings Ltd | Citibank | (2.359) | (17.751) | Breville Group Ltd | HSBC | 30.135 |
| 1.997 | ANZ Group Holdings Ltd | HSBC | (2.660) | (6.557) | Breville Group Ltd | JP Morgan | 10.464 |
| 2.289 | ANZ Group Holdings Ltd | JP Morgan | (2.787) | (5.972) | Brickworks Ltd | HSBC | 2.637 |
| 12.800 | APA Group (Unit) | Citibank | (2.763) | (8.303) | Brickworks Ltd | JP Morgan | 2.677 |
| 27.032 | APA Group (Unit) | HSBC | (16.531) | 9.142 | BWP Trust (REIT) | Citibank | (591) |
| 6.477 | APA Group (Unit) | JP Morgan | (3.635) | (10.164) | Calix Ltd | Citibank | 2.637 |
| (7.017) | APM Human Services International Ltd | Citibank | (612) | (177) | Calix Ltd | HSBC | 92 |
| (3.479) | APM Human Services International Ltd | JP Morgan | (197) | (4.088) | Calix Ltd | JP Morgan | 2.035 |
| 4.439 | Appen Ltd | Citibank | 2.197 | (23.739) | Capricorn Metals Ltd | HSBC | 7.063 |
| 2.957 | Appen Ltd | HSBC | 734 | 991 | Centuria Capital Group | HSBC | (49) |
| 2.704 | Appen Ltd | JP Morgan | 1.265 | (14.778) | Centuria Office (REIT) | Citibank | (13) |
| 739 | Appen Ltd (Right) | Citibank | 627 | (74.035) | Centuria Office (REIT) | JP Morgan | 3.548 |
| (120) | ARB Corp Ltd | Citibank | 229 | (483) | Chalice Mining Ltd | Citibank | 171 |
| (5.916) | ARB Corp Ltd | HSBC | 20.539 | (7.708) | Chalice Mining Ltd | HSBC | 4.439 |
| (4.281) | ARB Corp Ltd | JP Morgan | 14.562 | (17.358) | Chalice Mining Ltd | JP Morgan | 11.862 |
| 758 | Arena (REIT) | Citibank | 1 | 4.981 | Challenger Ltd | Citibank | 214 |
| 8.903 | Arena (REIT) | HSBC | (779) | 384 | Challenger Ltd | HSBC | (56) |
| 3.740 | Arena (REIT) | JP Morgan | (392) | 5.332 | Challenger Ltd | JP Morgan | (619) |
| (11.957) | Argosy Minerals Ltd | Citibank | 287 | (376) | Champion Iron Ltd | Citibank | 122 |
| 1.995 | Aristocrat Leisure Ltd | Citibank | (3.270) | (9.799) | Champion Iron Ltd | HSBC | 5.033 |
| 4.136 | Aristocrat Leisure Ltd | JP Morgan | (5.930) | (15.230) | Champion Iron Ltd | JP Morgan | 7.743 |
| (461) | ASX Ltd | HSBC | 1.688 | 4.562 | Charter Hall Group (REIT) | Citibank | (1.642) |
| (3.107) | ASX Ltd | JP Morgan | 10.339 | 4.479 | Charter Hall Group (REIT) | HSBC | (1.897) |
| (1.987) | AUB Group Ltd | HSBC | 3.333 | 4.738 | Charter Hall Group (REIT) | JP Morgan | (1.750) |
| (3.143) | AUB Group Ltd | JP Morgan | 4.869 | 2.315 | Charter Hall Long Wales (REIT) | Citibank | (155) |
| 6.246 | Auckland International Airport Ltd | Citibank | (1.622) | 17.385 | Charter Hall Long Wales (REIT) | HSBC | (3.633) |
| 13.110 | Auckland International Airport Ltd | HSBC | (3.158) | 8.884 | Charter Hall Long Wales (REIT) | JP Morgan | (1.668) |
| | | | | 50.030 | Charter Hall Retail (REIT) | Citibank | (4.222) |
| | | | | 12.768 | Charter Hall Retail (REIT) | HSBC | (2.902) |
| | | | | 125.803 | Charter Hall Retail (REIT) | JP Morgan | (26.703) |
| | | | | 10.246 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | Citibank | (263) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------|---|-------------|---|----------|---|-------------|---|
| | Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | |
| 6.119 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | HSBC | (891) | (23.562) | Domain Holdings Australia Ltd | HSBC | (508) |
| 9.724 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | JP Morgan | (1.275) | (55.178) | Domain Holdings Australia Ltd | JP Morgan | (2.053) |
| (15.183) | Chorus Ltd | HSBC | 7.447 | (712) | Domino's Pizza Enterprises Ltd | HSBC | 2.846 |
| (5.039) | Chorus Ltd | JP Morgan | 2.211 | 388 | Downer EDI Ltd | HSBC | (67) |
| (52.573) | Cleanaway Waste Management Ltd | HSBC | 6.043 | 10.130 | Downer EDI Ltd | JP Morgan | (1.573) |
| (109.463) | Cleanaway Waste Management Ltd | JP Morgan | 11.190 | 9.176 | Eagers Automotive Ltd | Citibank | (8.763) |
| 648 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | Citibank | (85) | (44) | EBOS Group Ltd | JP Morgan | 38 |
| 256 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | HSBC | (353) | 14.119 | Estia Health Ltd | Citibank | (1.298) |
| 1.362 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | JP Morgan | (1.746) | 12.100 | Estia Health Ltd | HSBC | (942) |
| 94 | Cochlear Ltd | Citibank | (453) | 3.018 | Estia Health Ltd | JP Morgan | (199) |
| 669 | Cochlear Ltd | HSBC | (4.802) | 2.142 | EVT Ltd | Citibank | 246 |
| 172 | Cochlear Ltd | JP Morgan | (599) | (1.668) | EVT Ltd | HSBC | 964 |
| (1.824) | Codan Ltd | JP Morgan | 490 | (418) | EVT Ltd | JP Morgan | 217 |
| 1.018 | Coles Group Ltd | HSBC | (341) | 1.772 | EVT Ltd | JP Morgan | (921) |
| 8.561 | Coles Group Ltd | JP Morgan | (4.691) | 1.191 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Citibank | (2.482) |
| (2.446) | Collins Foods Ltd | HSBC | 1.387 | 3.940 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | HSBC | (10.303) |
| (1.348) | Collins Foods Ltd | JP Morgan | 707 | 688 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | JP Morgan | (1.720) |
| (1.646) | Commonwealth Bank of Australia | JP Morgan | 4.575 | 4.650 | FleetPartners Group Ltd | Citibank | (65) |
| (1.270) | Computershare Ltd | HSBC | 565 | 13.164 | FleetPartners Group Ltd | JP Morgan | 43 |
| (1.577) | Computershare Ltd | JP Morgan | 536 | (13.283) | Fletcher Building Ltd | HSBC | 477 |
| (25.204) | Cooper Energy Ltd | Citibank | 222 | (7.210) | Fletcher Building Ltd | JP Morgan | 104 |
| (162.913) | Cooper Energy Ltd | JP Morgan | 2.798 | 1.056 | Flight Centre Travel Group Ltd | Citibank | (452) |
| (29.972) | Core Lithium Ltd | Citibank | 1.086 | 69 | Flight Centre Travel Group Ltd | HSBC | (74) |
| (21.992) | Core Lithium Ltd | HSBC | 421 | 4.902 | Flight Centre Travel Group Ltd | JP Morgan | (4.745) |
| (3.781) | Core Lithium Ltd | JP Morgan | 54 | 1.045 | Fortescue Metals Group Ltd | Citibank | (1.241) |
| (16.194) | Coronado Global Resources Inc - CDI | Citibank | 1.729 | (10.529) | G8 Education Ltd | HSBC | 1.308 |
| (41.909) | Coronado Global Resources Inc - CDI | JP Morgan | 8.804 | (19.077) | G8 Education Ltd | JP Morgan | 2.262 |
| (2.714) | Corporate Travel Management Ltd | HSBC | 2.066 | 110.917 | GDI Property Group Partnership (REIT) | Citibank | (1.952) |
| (4.816) | Corporate Travel Management Ltd | JP Morgan | 3.182 | 21.307 | GDI Property Group Partnership (REIT) | HSBC | (974) |
| (8.240) | Costa Group Holdings Ltd | HSBC | (103) | 24.397 | GDI Property Group Partnership (REIT) | JP Morgan | (1.029) |
| (55.869) | Costa Group Holdings Ltd | JP Morgan | (1.373) | (32.022) | Gold Road Resources Ltd | HSBC | 5.555 |
| 1.687 | Credit Corp Group Ltd | Citibank | (22) | 6.687 | Gold Road Resources Ltd | JP Morgan | (1.234) |
| 5.246 | Credit Corp Group Ltd | JP Morgan | (4.089) | (17.176) | Gold Road Resources Ltd | JP Morgan | 2.700 |
| 35.392 | Cromwell Property Group (REIT) | Citibank | (649) | 10.075 | GPT Group (REIT) | Citibank | (1.368) |
| 3.597 | Cromwell Property Group (REIT) | HSBC | (170) | 54.183 | GPT Group (REIT) | HSBC | (15.284) |
| 72.772 | Cromwell Property Group (REIT) | JP Morgan | (3.243) | 58.002 | GPT Group (REIT) | JP Morgan | (15.790) |
| (188) | CSL Ltd | HSBC | 1.141 | 2.019 | GrainCorp Ltd 'A' | Citibank | (588) |
| (119) | CSL Ltd | JP Morgan | 550 | (222) | GrainCorp Ltd 'A' | HSBC | (42) |
| 32.012 | CSR Ltd | Citibank | (12.634) | 3.437 | GrainCorp Ltd 'A' | HSBC | (536) |
| 19.236 | CSR Ltd | HSBC | (10.447) | (3.210) | GrainCorp Ltd 'A' | JP Morgan | (718) |
| 7.019 | CSR Ltd | JP Morgan | (3.600) | 11.025 | GrainCorp Ltd 'A' | JP Morgan | (4.156) |
| 8.661 | Data#3 Ltd | Citibank | (1.298) | (25.469) | Grange Resources Ltd | HSBC | 1.887 |
| 14.561 | Data#3 Ltd | HSBC | (5.090) | (34.249) | Grange Resources Ltd | JP Morgan | 2.437 |
| 12.985 | Data#3 Ltd | JP Morgan | (4.086) | 94.398 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | Citibank | (15.750) |
| (54.115) | De Grey Mining Ltd | HSBC | 10.626 | 3.584 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | HSBC | (973) |
| (62.744) | De Grey Mining Ltd | JP Morgan | 11.950 | 46.021 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | JP Morgan | (11.766) |
| (28.478) | Deep Yellow Ltd | JP Morgan | 151 | (240) | GUD Holdings Ltd | HSBC | 178 |
| 7.873 | Dexus (REIT) | Citibank | (222) | (5.233) | GUD Holdings Ltd | JP Morgan | 3.641 |
| 11.138 | Dexus (REIT) | HSBC | (701) | 5.158 | GWA Group Ltd | JP Morgan | (84) |
| 13.381 | Dexus (REIT) | JP Morgan | (1.451) | (11.689) | Hansen Technologies Ltd | HSBC | (2.639) |
| (20.490) | Dexus Industria (REIT) | HSBC | 3.482 | (6.419) | Hansen Technologies Ltd | JP Morgan | (1.585) |
| (30.126) | Dexus Industria (REIT) | JP Morgan | 4.692 | (4.150) | Harvey Norman Holdings Ltd | HSBC | 1.281 |
| (3.037) | Dicker Data Ltd | Citibank | 302 | (5.833) | Harvey Norman Holdings Ltd | JP Morgan | 1.698 |
| (929) | Dicker Data Ltd | JP Morgan | 140 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|---------------------------------------|-------------|---|-------------------------------|------------------------------------|-------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| 1.385 | Healius Ltd | Citibank | (13) | (66.558) | Leo Lithium Ltd | JP Morgan | (12.127) |
| (7.661) | Healius Ltd | HSBC | 182 | 479 | Life360 Inc - CDI | HSBC | 337 |
| (5.267) | Healius Ltd | JP Morgan | 48 | 978 | Life360 Inc - CDI | JP Morgan | 715 |
| 2.275 | Healius Ltd | JP Morgan | 118 | (34.256) | Link Administration Holdings Ltd | HSBC | 4.253 |
| (7.497) | HMC Capital Ltd (REIT) | JP Morgan | 60 | (11.877) | Link Administration Holdings Ltd | JP Morgan | 1.360 |
| (24.413) | HomeCo Daily Needs (REIT) | HSBC | 826 | (540) | Liontown Resources Ltd | Citibank | (16) |
| (24.752) | Hotel Property Investments Ltd (REIT) | JP Morgan | 3.906 | (30.796) | Liontown Resources Ltd | HSBC | 4.530 |
| (1.165) | HUB24 Ltd | HSBC | 2.656 | (11.941) | Liontown Resources Ltd | JP Morgan | 1.146 |
| (2.384) | HUB24 Ltd | JP Morgan | 5.123 | 1.105 | Lovisa Holdings Ltd | Citibank | (3.000) |
| (1.501) | IDP Education Ltd | HSBC | 6.269 | 2.617 | Lovisa Holdings Ltd | HSBC | (11.362) |
| (3.347) | IDP Education Ltd | JP Morgan | 12.537 | 2.961 | Lovisa Holdings Ltd | JP Morgan | (12.485) |
| (2.889) | IGO Ltd | HSBC | 2.439 | (5.039) | Lynas Rare Earths Ltd | HSBC | 334 |
| (4.769) | IGO Ltd | JP Morgan | 3.326 | (5.530) | Lynas Rare Earths Ltd | JP Morgan | 548 |
| (967) | Iluka Resources Ltd | HSBC | 418 | 932 | MA Financial Group Ltd | HSBC | (65) |
| (4.272) | Iluka Resources Ltd | JP Morgan | 1.254 | 847 | MA Financial Group Ltd | JP Morgan | (40) |
| 31.437 | Imdex Ltd | Citibank | (2.466) | (2.582) | Maas Group Holdings Ltd | JP Morgan | (120) |
| 32.989 | Imdex Ltd | HSBC | (8.952) | 8.792 | Magellan Financial Group Ltd | Citibank | (2.952) |
| 39.111 | Imdex Ltd | JP Morgan | (10.208) | 2.259 | Magellan Financial Group Ltd | HSBC | (1.552) |
| (90.190) | Imugene Ltd | HSBC | 615 | 1.232 | Magellan Financial Group Ltd | JP Morgan | (713) |
| (108.363) | Imugene Ltd | JP Morgan | 841 | 890 | Marley Spoon SE - CDI | Citibank | 1 |
| (16.261) | Incitec Pivot Ltd | HSBC | 4.039 | 12.138 | Marley Spoon SE - CDI | HSBC | (212) |
| (12.378) | Incitec Pivot Ltd | JP Morgan | 2.546 | 15.046 | Marley Spoon SE - CDI | JP Morgan | (252) |
| (1.792) | Ingenia Communities Group (REIT) | Citibank | 260 | 3.442 | Mayne Pharma Group Ltd | Citibank | (213) |
| (36.358) | Ingenia Communities Group (REIT) | HSBC | 9.746 | 4.159 | Mayne Pharma Group Ltd | HSBC | (2.382) |
| (75.229) | Ingenia Communities Group (REIT) | JP Morgan | 18.673 | 3.201 | Mayne Pharma Group Ltd | JP Morgan | (1.768) |
| 1.009 | Inghams Group Ltd | Citibank | (169) | 5.915 | McMillan Shakespeare Ltd | Citibank | (1.261) |
| 25.992 | Inghams Group Ltd | HSBC | (5.222) | 4.354 | McMillan Shakespeare Ltd | HSBC | (2.121) |
| 4.877 | Inghams Group Ltd | JP Morgan | (838) | (13.490) | Medibank Pvt Ltd | JP Morgan | 1.269 |
| 23.450 | Insignia Financial Ltd | Citibank | (3.380) | (1.001) | Megaport Ltd | HSBC | (671) |
| (586) | Insurance Australia Group Ltd | HSBC | 13 | (2.486) | Megaport Ltd | JP Morgan | (1.732) |
| (586) | Insurance Australia Group Ltd | JP Morgan | 13 | (11.404) | Mincor Resources NL | HSBC | 497 |
| (63.078) | Integral Diagnostics Ltd | JP Morgan | 5.126 | (48.581) | Mincor Resources NL | JP Morgan | 1.792 |
| (16.917) | InvoCare Ltd | HSBC | (6.620) | (27.349) | Mirvac Group (REIT) | JP Morgan | 3.317 |
| (1.407) | InvoCare Ltd | JP Morgan | (688) | 786 | Monadelphous Group Ltd | Citibank | (608) |
| (12.600) | IPH Ltd | HSBC | 6.684 | 606 | Monadelphous Group Ltd | JP Morgan | (527) |
| (33.442) | IPH Ltd | JP Morgan | 18.200 | 4.800 | MyState Ltd | HSBC | (465) |
| (364) | IRESS Ltd | Citibank | 58 | 2.236 | MyState Ltd | JP Morgan | (172) |
| (8.339) | IRESS Ltd | HSBC | 4.083 | 7.674 | Nanosonics Ltd | Citibank | (2.534) |
| (18.631) | IRESS Ltd | JP Morgan | 8.682 | 12.084 | Nanosonics Ltd | HSBC | (4.926) |
| (1.616) | James Hardie Industries Plc - CDI | HSBC | (2.219) | 14.147 | Nanosonics Ltd | JP Morgan | (5.400) |
| (570) | James Hardie Industries Plc - CDI | JP Morgan | (876) | (4.098) | National Australia Bank Ltd | HSBC | 6.460 |
| 878 | Janus Henderson Group Plc - CDI | Citibank | (219) | (1.827) | Netwealth Group Ltd | HSBC | 1.677 |
| 874 | Janus Henderson Group Plc - CDI | HSBC | (312) | (2.671) | Netwealth Group Ltd | JP Morgan | 2.215 |
| 2.011 | Janus Henderson Group Plc - CDI | JP Morgan | (436) | (1.587) | Neuren Pharmaceuticals Ltd | Citibank | 1.111 |
| (3.921) | Johns Lyng Group Ltd | HSBC | 2.080 | 3.152 | Newcrest Mining Ltd | Citibank | (3.894) |
| (5.556) | Johns Lyng Group Ltd | JP Morgan | 2.719 | 69 | Newcrest Mining Ltd | HSBC | (238) |
| 39.034 | Judo Capital Holdings Ltd | Citibank | (319) | (23) | News Corp - CDI | Citibank | (4) |
| 15.933 | Judo Capital Holdings Ltd | JP Morgan | (1.402) | (153) | News Corp - CDI | HSBC | (232) |
| 2.140 | Jumbo Interactive Ltd | Citibank | (307) | (1.819) | News Corp - CDI | JP Morgan | (2.979) |
| 3.603 | Jumbo Interactive Ltd | HSBC | (1.192) | (13.456) | NEXTDC Ltd | HSBC | (3.262) |
| 4.352 | Jumbo Interactive Ltd | JP Morgan | (1.040) | (2.041) | NEXTDC Ltd | HSBC | (2.526) |
| (24.764) | Karoon Energy Ltd | HSBC | 4.226 | (6.065) | NEXTDC Ltd | JP Morgan | (1.813) |
| (11.017) | Karoon Energy Ltd | JP Morgan | 1.766 | (800) | NEXTDC Ltd | JP Morgan | (990) |
| 2.568 | Kelsian Group Ltd | Citibank | (254) | (3.577) | nib holdings Ltd | HSBC | (105) |
| 4.396 | Kelsian Group Ltd | HSBC | 591 | (1.470) | nib holdings Ltd | JP Morgan | (98) |
| 9.050 | Kelsian Group Ltd | JP Morgan | 1.490 | 183 | Nick Scali Ltd | Citibank | (122) |
| (28.118) | Lake Resources NL | HSBC | 273 | 886 | Nick Scali Ltd | HSBC | (850) |
| (22.447) | Leo Lithium Ltd | Citibank | (1.700) | 1.421 | Nick Scali Ltd | JP Morgan | (1.127) |
| | | | | (62.700) | Nickel Industries Ltd | HSBC | 3.899 |
| | | | | (49.130) | Nickel Industries Ltd | JP Morgan | 3.146 |
| | | | | (28.228) | Nine Entertainment Co Holdings Ltd | HSBC | 4.053 |
| | | | | (102.518) | Nine Entertainment Co Holdings Ltd | JP Morgan | 13.732 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--|-------------|---|-------------------------------|---------------------------------|-------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| (10.665) | NRW Holdings Ltd | HSBC | 2.463 | 30.372 | Resolute Mining Ltd | Citibank | 176 |
| (23.766) | NRW Holdings Ltd | JP Morgan | 5.210 | 112.434 | Resolute Mining Ltd | JP Morgan | (3.317) |
| 8.752 | Nufarm Ltd | Citibank | (1.787) | 15.648 | Ridley Corp Ltd | Citibank | (1.670) |
| 2.593 | Nufarm Ltd | HSBC | (563) | 7.827 | Ridley Corp Ltd | HSBC | (1.277) |
| 4.818 | Nufarm Ltd | JP Morgan | (919) | 20.710 | Ridley Corp Ltd | JP Morgan | (3.269) |
| 20.465 | OFX Group Ltd | JP Morgan | 3.981 | 543 | Rio Tinto Ltd | Citibank | (1.710) |
| (21.294) | Omni Bridgeway Ltd | HSBC | 1.206 | (1.060) | Rural Funds Group (REIT) | HSBC | 203 |
| (4.684) | Omni Bridgeway Ltd | JP Morgan | 206 | (9.983) | Rural Funds Group (REIT) | JP Morgan | 1.820 |
| 67.953 | oOh!media Ltd | Citibank | (3.092) | 4.878 | Sandfire Resources Ltd | Citibank | (663) |
| 31.930 | oOh!media Ltd | HSBC | (2.081) | (322) | Sandfire Resources Ltd | Citibank | 44 |
| 72.961 | oOh!media Ltd | JP Morgan | (4.313) | 2.216 | Sandfire Resources Ltd | HSBC | (1.826) |
| 2.442 | Orica Ltd | Citibank | (1.455) | (7.420) | Sandfire Resources Ltd | HSBC | 5.180 |
| 1.707 | Orica Ltd | HSBC | (2.378) | 1.059 | Sandfire Resources Ltd | JP Morgan | (839) |
| 3.860 | Orica Ltd | JP Morgan | (5.069) | (18.139) | Sandfire Resources Ltd | JP Morgan | 13.983 |
| 9.196 | Orora Ltd | Citibank | (592) | (2.285) | Santos Ltd | HSBC | 341 |
| 15.417 | Orora Ltd | HSBC | (2.051) | (3.977) | Santos Ltd | JP Morgan | 791 |
| 13.936 | Orora Ltd | JP Morgan | (1.535) | (301.311) | Sayona Mining Ltd | HSBC | 6.431 |
| (6.539) | Paladin Energy Ltd | Citibank | 488 | 74.119 | Scentre Group (REIT) | Citibank | (7.057) |
| (70.246) | Paladin Energy Ltd | HSBC | 6.440 | 53.669 | Scentre Group (REIT) | HSBC | (10.726) |
| (136.811) | Paladin Energy Ltd | JP Morgan | 11.940 | 28.784 | Scentre Group (REIT) | JP Morgan | (5.037) |
| 74.761 | Perenti Ltd | Citibank | (1.366) | (2.094) | SEEK Ltd | JP Morgan | 1.538 |
| 21.543 | Perenti Ltd | HSBC | (2.105) | (35.068) | Select Harvests Ltd | JP Morgan | 7.659 |
| 28.244 | Perenti Ltd | JP Morgan | (2.588) | (157.178) | Service Stream Ltd | JP Morgan | 11.576 |
| 1.943 | Perpetual Ltd | Citibank | (464) | 3.145 | Seven Group Holdings Ltd | HSBC | (2.931) |
| 24.251 | Perseus Mining Ltd | Citibank | (3.504) | (62.156) | Seven West Media Ltd | Citibank | 358 |
| 17.036 | Perseus Mining Ltd | HSBC | (5.537) | (36.527) | Seven West Media Ltd | JP Morgan | (260) |
| 29.388 | Perseus Mining Ltd | JP Morgan | (9.240) | (2.588) | Sigma Healthcare Ltd | HSBC | 140 |
| (3.110) | PEXA Group Ltd | HSBC | 1.752 | (182.021) | Sigma Healthcare Ltd | JP Morgan | 9.049 |
| (1.458) | PEXA Group Ltd | JP Morgan | 728 | (874) | Silex Systems Ltd | Citibank | 16 |
| (15.765) | Pilbara Minerals Ltd | HSBC | 4.200 | (5.922) | Silex Systems Ltd | JP Morgan | (1.385) |
| (4.138) | Pilbara Minerals Ltd | JP Morgan | 1.011 | 19.882 | Silver Lake Resources Ltd | Citibank | (191) |
| (6.465) | Pinnacle Investment Management Group Ltd | HSBC | 1.629 | 18.488 | Silver Lake Resources Ltd | HSBC | (1.277) |
| (20.132) | Pinnacle Investment Management Group Ltd | JP Morgan | 5.014 | 25.941 | Silver Lake Resources Ltd | JP Morgan | (499) |
| (3.859) | Platinum Asset Management Ltd | JP Morgan | 142 | 5.617 | Sims Ltd | Citibank | (3.886) |
| (190) | Pointsbet Holdings Ltd | HSBC | — | 2.984 | Sims Ltd | HSBC | (4.076) |
| (203) | Pointsbet Holdings Ltd | JP Morgan | — | 1.809 | Sims Ltd | JP Morgan | (2.336) |
| (880) | PointsBet Holdings Ltd | Citibank | 143 | (5.249) | SiteMinder Ltd | JP Morgan | 377 |
| (790) | PointsBet Holdings Ltd | HSBC | 288 | (195) | SKY Network Television Ltd | HSBC | 29 |
| 7.530 | PolyNovo Ltd | JP Morgan | (117) | 40.783 | SKYCITY Entertainment Group Ltd | Citibank | (4.781) |
| 1.828 | Premier Investments Ltd | Citibank | (3.257) | 16.704 | SKYCITY Entertainment Group Ltd | HSBC | (1.979) |
| 2.111 | Premier Investments Ltd | HSBC | (6.118) | 17.665 | SKYCITY Entertainment Group Ltd | JP Morgan | (1.912) |
| 4.405 | Premier Investments Ltd | JP Morgan | (12.224) | 1.354 | SmartGroup Corp Ltd | Citibank | (144) |
| 2.246 | Pro Medicus Ltd | Citibank | (3.501) | 1.086 | SmartGroup Corp Ltd | HSBC | (223) |
| 2.287 | Pro Medicus Ltd | JP Morgan | (3.751) | 1.104 | SmartGroup Corp Ltd | JP Morgan | (272) |
| 326 | PWR Holdings Ltd | HSBC | (282) | 460 | Sonic Healthcare Ltd | HSBC | (536) |
| 4.431 | Qantas Airways Ltd | Citibank | (17) | 1.542 | Sonic Healthcare Ltd | JP Morgan | (2.178) |
| 4.442 | QBE Insurance Group Ltd | Citibank | (1.364) | (3.136) | South32 Ltd | HSBC | 1.060 |
| 1.965 | QBE Insurance Group Ltd | HSBC | (464) | 6.012 | Spark New Zealand Ltd | HSBC | (579) |
| 1.388 | Qube Holdings Ltd | HSBC | (44) | 1.573 | Spark New Zealand Ltd | JP Morgan | (253) |
| 12.720 | Qube Holdings Ltd | JP Morgan | (2.453) | 2.499 | SSR Mining Inc - CDI | Citibank | (3.514) |
| 23.987 | Ramelius Resources Ltd | JP Morgan | (1.830) | 603 | SSR Mining Inc - CDI | HSBC | (1.637) |
| 182 | Ramsay Health Care Ltd | HSBC | (796) | 145 | SSR Mining Inc - CDI | JP Morgan | (376) |
| (450) | REA Group Ltd | HSBC | 2.680 | 14.982 | St Barbara Ltd | HSBC | (901) |
| (1.306) | REA Group Ltd | JP Morgan | 6.722 | 10.169 | St Barbara Ltd | JP Morgan | (177) |
| (4.542) | Reece Ltd | HSBC | 2.785 | 27.459 | Star Entertainment Grp Ltd | Citibank | (1.225) |
| (10.812) | Reece Ltd | JP Morgan | 5.684 | 18.228 | Star Entertainment Grp Ltd | HSBC | (1.884) |
| 13.357 | Region RE Ltd (REIT) | Citibank | (167) | 29.397 | Star Entertainment Grp Ltd | JP Morgan | (2.492) |
| 8.236 | Region RE Ltd (REIT) | HSBC | (924) | 2.057 | Steadfast Group Ltd | HSBC | (147) |
| 1.876 | Region RE Ltd (REIT) | JP Morgan | (187) | (11.788) | Stockland (REIT) | HSBC | 4.126 |
| 2.184 | Regis Resources Ltd | Citibank | (98) | (9.556) | Stockland (REIT) | JP Morgan | 3.134 |
| 4.150 | Regis Resources Ltd | HSBC | (740) | (65.494) | Strike Energy Ltd | Citibank | 706 |
| (4.704) | Regis Resources Ltd | HSBC | 299 | (97.455) | Strike Energy Ltd | JP Morgan | (650) |
| (13.513) | Reliance Worldwide Corp Ltd | HSBC | 1.493 | 5.325 | Suncorp Group Ltd | Citibank | 806 |
| (29.242) | Reliance Worldwide Corp Ltd | JP Morgan | 2.645 | 11.102 | Suncorp Group Ltd | JP Morgan | 1.499 |
| 298 | ResMed Inc - CDI | Citibank | (433) | 15.343 | Super Retail Group Ltd | Citibank | (10.766) |
| | | | | (1.257) | Super Retail Group Ltd | HSBC | 1.651 |
| | | | | 6.031 | Super Retail Group Ltd | HSBC | (7.920) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|---------------------------------|-------------|---|-----------------|---|---------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | China | | | |
| 3.460 | Super Retail Group Ltd | JP Morgan | (4.331) | (1.000) | Alphamab Oncology | Citibank | 110 |
| (8.142) | Syrah Resources Ltd | Citibank | 376 | (3.000) | Alphamab Oncology | JP Morgan | 2.778 |
| (46.972) | Syrah Resources Ltd | HSBC | 4.236 | 300 | Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (1.623) |
| (11.620) | Syrah Resources Ltd | JP Morgan | 1.084 | (2.500) | China Resources Pharmaceutical Group Ltd | Citibank | 1 |
| (14.174) | Tabcorp Holdings Ltd | HSBC | (105) | 9.800 | DaShenLin Pharmaceutical Group Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.314) |
| 1.431 | Telix Pharmaceuticals Ltd | Citibank | (51) | 19.500 | Fujian Sunner Development Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (4.307) |
| 305 | Telix Pharmaceuticals Ltd | HSBC | 59 | 22.200 | Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd 'A' | Goldman Sachs | (3.292) |
| 932 | Telix Pharmaceuticals Ltd | JP Morgan | 177 | 1.400 | ZTE Corp 'A' | Goldman Sachs | 604 |
| 53.623 | Telstra Group Ltd | HSBC | (5.354) | | | | (8.043) |
| 77.097 | Telstra Group Ltd | JP Morgan | (6.966) | Hongkong | | | |
| (2.648) | Temple & Webster Group Ltd | Citibank | 547 | 6.000 | 361 Degrees International Ltd | HSBC | (500) |
| (6.055) | Temple & Webster Group Ltd | JP Morgan | (2.499) | 5.000 | 361 Degrees International Ltd | JP Morgan | (417) |
| (3.766) | Tietto Minerals Ltd | Citibank | 79 | 2.500 | 3SBio Inc | Citibank | 11 |
| (9.354) | Tietto Minerals Ltd | HSBC | 525 | 2.500 | 3SBio Inc | HSBC | (5) |
| (130.953) | Tietto Minerals Ltd | JP Morgan | 7.006 | 22.000 | 3SBio Inc | JP Morgan | (46) |
| (22.453) | TPG Telecom Ltd | HSBC | 4.366 | 27.000 | AAC Technologies Holdings Inc | Citibank | (4.035) |
| (28.515) | TPG Telecom Ltd | JP Morgan | 3.635 | 2.500 | AAC Technologies Holdings Inc | HSBC | (278) |
| 8.754 | Transurban Group (Unit) | Citibank | (503) | 2.000 | AAC Technologies Holdings Inc | JP Morgan | (222) |
| 5.542 | Transurban Group (Unit) | HSBC | (1.767) | 1.000 | Acotec Scientific Holdings Ltd | HSBC | 31 |
| 26.937 | Transurban Group (Unit) | JP Morgan | (8.003) | 23.000 | Acotec Scientific Holdings Ltd | JP Morgan | 721 |
| (1.735) | Treasury Wine Estates Ltd | HSBC | 2.772 | 21.000 | Agricultural Bank of China Ltd 'H' | Citibank | (498) |
| 4.287 | Unibail-Rodamco-Westfield - CDI | Citibank | (404) | 2.000 | Agricultural Bank of China Ltd 'H' | HSBC | (80) |
| 5.882 | Unibail-Rodamco-Westfield - CDI | HSBC | (1.248) | 22.000 | Agricultural Bank of China Ltd 'H' | JP Morgan | (883) |
| 16.964 | Unibail-Rodamco-Westfield - CDI | JP Morgan | (4.081) | 4.000 | AIA Group Ltd | Citibank | (2.549) |
| (658) | United Malt Grp Ltd | Citibank | 37 | 1.600 | AIA Group Ltd | HSBC | (1.787) |
| (31.961) | United Malt Grp Ltd | HSBC | 8.821 | 16.800 | AIA Group Ltd | JP Morgan | (18.775) |
| (44.260) | United Malt Grp Ltd | JP Morgan | 11.046 | (2.000) | AK Medical Holdings Ltd | Citibank | 170 |
| 25.844 | Ventia Services Group Pty Ltd | Citibank | (746) | (8.000) | AK Medical Holdings Ltd | HSBC | 1.294 |
| 71.495 | Ventia Services Group Pty Ltd | JP Morgan | 679 | 1.000 | Akeso Inc | Citibank | (385) |
| 7.864 | Vicinity Ltd (REIT) | Citibank | (242) | 1.000 | Akeso Inc | HSBC | (1.247) |
| 20.508 | Vicinity Ltd (REIT) | JP Morgan | (3.837) | 2.000 | Akeso Inc | JP Morgan | (2.495) |
| 10.349 | Viva Energy Group Ltd | Citibank | (853) | 4.400 | Alibaba Group Holding Ltd | Citibank | (3.286) |
| (4.061) | Viva Energy Group Ltd | JP Morgan | 132 | 3.400 | Alibaba Group Holding Ltd | HSBC | (1.694) |
| 6.866 | Viva Energy Group Ltd | JP Morgan | 167 | 3.000 | Alibaba Group Holding Ltd | JP Morgan | (1.497) |
| 24.193 | Waypoint Ltd (REIT) | Citibank | (844) | (20.000) | Alibaba Health Information Technology Ltd | Citibank | 686 |
| 9.975 | Waypoint Ltd (REIT) | HSBC | (626) | (6.000) | Alibaba Health Information Technology Ltd | HSBC | 636 |
| 23.473 | Waypoint Ltd (REIT) | JP Morgan | (1.177) | (4.000) | Alibaba Health Information Technology Ltd | JP Morgan | 424 |
| (25.702) | Webjet Ltd | HSBC | 4.178 | 570.000 | Alibaba Pictures Group Ltd | Citibank | (2.603) |
| (12.595) | Webjet Ltd | JP Morgan | 1.774 | 140.000 | Alibaba Pictures Group Ltd | HSBC | (1.236) |
| 1.112 | Wesfarmers Ltd | HSBC | (3.471) | 470.000 | Alibaba Pictures Group Ltd | JP Morgan | (4.151) |
| 37.415 | West African Resources Ltd | Citibank | (1.496) | (36.000) | Alliance International Education Leasing Holdings Ltd | Citibank | 92 |
| 23.719 | West African Resources Ltd | HSBC | (2.653) | 48.000 | Aluminum Corp of China Ltd 'H' | Citibank | (2.739) |
| 21.819 | West African Resources Ltd | JP Morgan | (2.319) | 6.000 | Aluminum Corp of China Ltd 'H' | HSBC | (1.004) |
| 35.840 | Westgold Resources Ltd | Citibank | (504) | 60.000 | Aluminum Corp of China Ltd 'H' | JP Morgan | (10.047) |
| 50.018 | Westgold Resources Ltd | JP Morgan | (8.107) | 123.600 | Angang Steel Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (6.129) |
| 2.969 | Westpac Banking Corp | JP Morgan | (3.740) | 96.000 | Angang Steel Co Ltd 'H' | Citibank | (2.501) |
| (343) | WiseTech Global Ltd | HSBC | (756) | | | | |
| 2.895 | Woolworths Group Ltd | Citibank | (2.843) | | | | |
| 445 | Woolworths Group Ltd | HSBC | (769) | | | | |
| 2.733 | Woolworths Group Ltd | JP Morgan | (4.578) | | | | |
| (1.131) | Worley Ltd | HSBC | (92) | | | | |
| 420 | Xero Ltd | Citibank | (593) | | | | |
| 74 | Xero Ltd | JP Morgan | 625 | | | | |
| | | | (60.353) | | | | |
| Kaimaninseln | | | | | | | |
| 841 | Weibo Corp ADR | Citibank | (2.901) | | | | |
| 976 | Weibo Corp ADR | HSBC | (2.538) | | | | |
| 2.475 | Weibo Corp ADR | JP Morgan | (6.435) | | | | |
| (14.000) | Wynn Macau Ltd | Citibank | 648 | | | | |
| | | | (11.226) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|---------------|---|-----------------------------|---|---------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 80.000 | Angang Steel Co Ltd 'H' | HSBC | (6.690) | (132.000) | Beijing Enterprises Water Group Ltd | Citibank | 1.746 |
| 32.000 | Angang Steel Co Ltd 'H' | JP Morgan | (2.677) | (6.000) | Beijing Enterprises Water Group Ltd | JP Morgan | 166 |
| 8.000 | Anhui Conch Cement Co Ltd 'H' | Citibank | (1.931) | 14.000 | Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H' | Citibank | (328) |
| 500 | Anhui Conch Cement Co Ltd 'H' | HSBC | (246) | 2.000 | Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H' | HSBC | (42) |
| 5.000 | Anhui Conch Cement Co Ltd 'H' | JP Morgan | (2.462) | 98.000 | Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H' | JP Morgan | (2.083) |
| 6.000 | Anhui Expressway Co Ltd 'H' | Citibank | (533) | 113.500 | Beijing Yanjing Brewery Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (12.024) |
| 2.000 | Anhui Expressway Co Ltd 'H' | HSBC | (223) | 400 | Bilibili Inc 'Z' | Citibank | (912) |
| 16.000 | Anhui Expressway Co Ltd 'H' | JP Morgan | (1.786) | 80 | Bilibili Inc 'Z' | HSBC | (291) |
| 1.400 | Anjoy Foods Group Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (1.393) | 280 | Bilibili Inc 'Z' | JP Morgan | (1.020) |
| 8.600 | ANTA Sports Products Ltd | Citibank | (8.900) | (3.500) | BOC Hong Kong Holdings Ltd | Citibank | 466 |
| 7.000 | ANTA Sports Products Ltd | HSBC | (12.619) | 864.900 | BOE Technology Group Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (12.665) |
| 400 | ANTA Sports Products Ltd | JP Morgan | (816) | 36.000 | Bosideng International Holdings Ltd | Citibank | (1.132) |
| 50.000 | Antengene Corp Ltd | Citibank | (2.323) | 22.000 | Bosideng International Holdings Ltd | HSBC | (1.357) |
| 2.500 | Antengene Corp Ltd | HSBC | (267) | 100.000 | Bosideng International Holdings Ltd | JP Morgan | (6.172) |
| 22.000 | Antengene Corp Ltd | JP Morgan | (2.346) | 4.000 | Brii Biosciences Ltd | Citibank | (96) |
| 33.000 | Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd' | Citibank | (4.590) | 6.000 | Brii Biosciences Ltd | HSBC | (240) |
| 21.000 | Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd' | HSBC | (2.903) | 12.500 | Brii Biosciences Ltd | JP Morgan | (500) |
| 80.000 | Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd' | JP Morgan | (11.059) | 13.500 | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | HSBC | (4.188) |
| (400) | Ascentage Pharma Group International | Citibank | (31) | 7.900 | BYD Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (19.416) |
| (1.000) | Ascentage Pharma Group International | JP Morgan | 155 | 500 | BYD Co Ltd 'H' | JP Morgan | (203) |
| 31.000 | Ascletris Pharma Inc | HSBC | (3.542) | 13.500 | BYD Electronic International Co Ltd | Citibank | (1.624) |
| (11.200) | AsialInfo Technologies Ltd | JP Morgan | 2.395 | 500 | BYD Electronic International Co Ltd | HSBC | (48) |
| 5.400 | ASMPT Ltd | Citibank | 1.057 | 5.000 | BYD Electronic International Co Ltd | JP Morgan | (485) |
| 300 | ASMPT Ltd | HSBC | 117 | 88.000 | Cafe de Coral Holdings Ltd | Citibank | (15.725) |
| 3.900 | ASMPT Ltd | JP Morgan | 1.523 | 16.000 | Cafe de Coral Holdings Ltd | HSBC | (3.227) |
| 4.550 | Baidu Inc 'A' | Citibank | (2.801) | 2.000 | Cafe de Coral Holdings Ltd | JP Morgan | (403) |
| 3.450 | Baidu Inc 'A' | HSBC | 961 | (5.900) | CALB Group Co Ltd | Citibank | 1.310 |
| 5.300 | Baidu Inc 'A' | JP Morgan | (941) | (111.000) | Canvest Environmental Protection Group Co Ltd | Citibank | 333 |
| 6.000 | Bairong Inc | Citibank | (696) | (62.000) | Canvest Environmental Protection Group Co Ltd | HSBC | 1.447 |
| 1.500 | Bairong Inc | HSBC | (121) | (13.000) | Canvest Environmental Protection Group Co Ltd | JP Morgan | 300 |
| 13.500 | Bairong Inc | JP Morgan | (1.136) | 28.500 | CARsgen Therapeutics Holdings Ltd | Citibank | (3.421) |
| 1.000 | Bank of Communications Co Ltd 'H' | Citibank | (25) | 500 | CARsgen Therapeutics Holdings Ltd | HSBC | (87) |
| 45.600 | Bank of East Asia Ltd | Citibank | (2.376) | 500 | CARsgen Therapeutics Holdings Ltd | JP Morgan | (87) |
| 47.400 | Bank of East Asia Ltd | HSBC | (4.545) | 1.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | Citibank | (57) |
| 41.600 | Bank of East Asia Ltd | JP Morgan | (3.992) | 1.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | HSBC | (38) |
| 23.000 | BBMG Corp 'H' | Citibank | (269) | 8.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | JP Morgan | (303) |
| 23.000 | BBMG Corp 'H' | JP Morgan | (553) | 54.000 | Central China New Life Ltd | Citibank | (1.275) |
| (1.200) | BeiGene Ltd | Citibank | 1.402 | 13.000 | Central China New Life Ltd | HSBC | (489) |
| (400) | BeiGene Ltd | HSBC | 1.038 | 8.000 | Central China New Life Ltd | JP Morgan | (301) |
| (400) | BeiGene Ltd | JP Morgan | 1.038 | (360.000) | CGN Mining Co Ltd | Citibank | 1.444 |
| 10.000 | Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H' | HSBC | (586) | (210.000) | CGN Mining Co Ltd | JP Morgan | 535 |
| 12.000 | Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H' | JP Morgan | (704) | (900) | Chervon Holdings Ltd | Citibank | (62) |
| (750) | Beijing Chunlizhengda Medical Instruments Co Ltd 'H' | HSBC | 302 | (2.900) | Chervon Holdings Ltd | JP Morgan | 440 |
| (3.250) | Beijing Chunlizhengda Medical Instruments Co Ltd 'H' | JP Morgan | 1.070 | 95.000 | China Aoyuan Group Ltd' | Citibank | (8.382) |
| 8.000 | Beijing Enterprises Holdings Ltd | Citibank | (2.511) | 24.000 | China Aoyuan Group Ltd' | HSBC | (2.105) |
| 7.500 | Beijing Enterprises Holdings Ltd | HSBC | (4.631) | 23.000 | China Aoyuan Group Ltd' | JP Morgan | (841) |
| 1.500 | Beijing Enterprises Holdings Ltd | JP Morgan | (927) | (599.000) | China Cinda Asset Management Co Ltd 'H' | Citibank | 5.481 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|-----------|--|-------------|--|-----------|---|-------------|--|
| | Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | |
| (112.000) | China Cinda Asset Management Co Ltd 'H' | JP Morgan | 2.262 | (31.000) | China Medical System Holdings Ltd | Citibank | 5.231 |
| (145.000) | China Conch Environment Protection Holdings Ltd | Citibank | 2.302 | (9.000) | China Medical System Holdings Ltd | JP Morgan | 2.432 |
| (24.000) | China Conch Environment Protection Holdings Ltd | HSBC | 568 | (6.000) | China Meidong Auto Holdings Ltd | Citibank | 1.625 |
| (18.000) | China Conch Environment Protection Holdings Ltd | JP Morgan | 427 | (6.000) | China Meidong Auto Holdings Ltd | HSBC | 1.775 |
| (22.000) | China Conch Venture Holdings Ltd | Citibank | 3.369 | (56.000) | China Mengniu Dairy Co Ltd | Citibank | 7.550 |
| (10.000) | China Conch Venture Holdings Ltd | JP Morgan | 3.699 | (17.000) | China Mengniu Dairy Co Ltd | HSBC | 6.814 |
| 7.000 | China Construction Bank Corp 'H' | Citibank | (321) | 11.000 | China Merchants Bank Co Ltd 'H' | Citibank | (3.397) |
| 8.000 | China Construction Bank Corp 'H' | HSBC | (623) | 1.500 | China Merchants Bank Co Ltd 'H' | HSBC | (972) |
| 65.000 | China Construction Bank Corp 'H' | JP Morgan | (5.064) | 10.000 | China Merchants Bank Co Ltd 'H' | JP Morgan | (6.482) |
| (32.000) | China Datang Corp Renewable Power Co Ltd 'H' | Citibank | 1.248 | (12.000) | China Merchants Port Holdings Co Ltd | Citibank | 996 |
| 12.000 | China Education Group Holdings Ltd | Citibank | (677) | (33.600) | China Merchants Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 1.690 |
| 1.000 | China Education Group Holdings Ltd | HSBC | (163) | (376.000) | China Modern Dairy Holdings Ltd | Citibank | 2.002 |
| 12.000 | China Education Group Holdings Ltd | JP Morgan | (1.956) | (14.000) | China Modern Dairy Holdings Ltd | JP Morgan | 39 |
| (199.000) | China Everbright Bank Co Ltd 'H' | Citibank | 3.927 | (26.000) | China National Building Material Co Ltd 'H' | Citibank | 2.054 |
| (137.000) | China Everbright Environment Group Ltd | Citibank | 3.950 | 13.000 | China New Higher Education Group Ltd | HSBC | (208) |
| (4.000) | China Everbright Environment Group Ltd | HSBC | 227 | 6.000 | China New Higher Education Group Ltd | JP Morgan | (116) |
| 40.000 | China Everbright Ltd | Citibank | (2.450) | (146.000) | China Overseas Grand Oceans Group Ltd | Citibank | 13.000 |
| 28.000 | China Everbright Ltd | HSBC | (3.179) | (32.000) | China Overseas Grand Oceans Group Ltd | JP Morgan | 4.094 |
| 12.000 | China Everbright Ltd | JP Morgan | (1.363) | (8.000) | China Overseas Land & Investment Ltd | Citibank | 2.075 |
| (103.000) | China Feihe Ltd | Citibank | 6.166 | (24.000) | China Overseas Land & Investment Ltd | HSBC | 13.889 |
| (16.000) | China Feihe Ltd | HSBC | 1.512 | (11.500) | China Overseas Land & Investment Ltd | JP Morgan | 6.657 |
| (7.000) | China Feihe Ltd | JP Morgan | 662 | 5.000 | China Overseas Property Holdings Ltd | JP Morgan | (839) |
| (159.000) | China Galaxy Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 8.286 | 400 | China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' | Citibank | (204) |
| 22.200 | China Gas Holdings Ltd | Citibank | (3.452) | 1.000 | China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' | HSBC | (766) |
| 49.600 | China Gas Holdings Ltd | HSBC | (10.770) | 19.800 | China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (15.178) |
| 68.200 | China Gas Holdings Ltd | JP Morgan | (14.814) | 50.000 | China Petroleum & Chemical Corp 'H' | Citibank | (1.463) |
| 40.000 | China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd | JP Morgan | (1.047) | 30.000 | China Petroleum & Chemical Corp 'H' | HSBC | (1.687) |
| 13.500 | China Hongqiao Group Ltd | Citibank | (1.571) | 78.000 | China Petroleum & Chemical Corp 'H' | JP Morgan | (4.388) |
| 17.500 | China Hongqiao Group Ltd | HSBC | (5.307) | (62.000) | China Power International Development Ltd | Citibank | 2.024 |
| 38.500 | China Hongqiao Group Ltd | JP Morgan | (11.678) | (39.000) | China Power International Development Ltd | JP Morgan | 372 |
| (698.000) | China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' | Citibank | 2.738 | (46.000) | China Railway Group Ltd 'H' | Citibank | 1.348 |
| (19.200) | China International Capital Corp Ltd 'H' | Citibank | 4.482 | (19.000) | China Railway Group Ltd 'H' | JP Morgan | 2.278 |
| (21.600) | China International Capital Corp Ltd 'H' | JP Morgan | 8.083 | 157.000 | China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'H' | Citibank | (2.725) |
| (118.000) | China Jinmao Holdings Group Ltd | Citibank | 2.595 | 207.000 | China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'H' | HSBC | (9.608) |
| (44.000) | China Jinmao Holdings Group Ltd | JP Morgan | 2.120 | 59.000 | China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'H' | JP Morgan | (2.740) |
| 6.000 | China Kepei Education Group Ltd | HSBC | (50) | | | | |
| (42.000) | China Life Insurance Co Ltd 'H' | Citibank | 8.183 | | | | |
| (11.000) | China Life Insurance Co Ltd 'H' | HSBC | 3.443 | | | | |
| 400 | China Literature Ltd | Citibank | (118) | | | | |
| (39.000) | China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H' | Citibank | 1.824 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|---------------|---|-----------------------------|--|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 2.000 | China Resources Beer Holdings Co Ltd | Citibank | (1.314) | 7.000 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | JP Morgan | (1.011) |
| 8.000 | China Resources Beer Holdings Co Ltd | JP Morgan | (7.253) | (50.000) | China Youran Dairy Group Ltd | Citibank | 979 |
| (46.000) | China Resources Cement Holdings Ltd | Citibank | 1.383 | (314.000) | China Youran Dairy Group Ltd | JP Morgan | 10.237 |
| (70.000) | China Resources Cement Holdings Ltd | JP Morgan | 6.646 | 560.000 | China Youzan Ltd | Citibank | (1.020) |
| (28.900) | China Resources Gas Group Ltd | Citibank | 10.703 | 112.000 | China Youzan Ltd | HSBC | (510) |
| (2.900) | China Resources Gas Group Ltd | JP Morgan | 833 | 148.000 | China Youzan Ltd | JP Morgan | (675) |
| (22.000) | China Resources Land Ltd | Citibank | 8.447 | 220.000 | China Yuhua Education Corp Ltd | Citibank | (2.298) |
| (32.500) | China Resources Medical Holdings Co Ltd | Citibank | 1.833 | 108.000 | China Yuhua Education Corp Ltd | HSBC | (2.592) |
| (10.400) | China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd | Citibank | 1.481 | 294.000 | China Yuhua Education Corp Ltd | JP Morgan | (7.058) |
| (2.000) | China Resources Power Holdings Co Ltd | Citibank | 162 | 27.600 | China Zhongwang Holdings Ltd* | Citibank | (5.909) |
| 1.500 | China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | 518 | 56.000 | China Zhongwang Holdings Ltd* | HSBC | (11.985) |
| (10.000) | China Risun Group Ltd | Citibank | 187 | 28.800 | China Zhongwang Holdings Ltd** | JP Morgan | — |
| (52.000) | China Ruyi Holdings Ltd | Citibank | 87 | (44.000) | Chinasoft International Ltd | Citibank | 1.525 |
| (8.000) | China Ruyi Holdings Ltd | HSBC | 119 | (8.000) | Chinasoft International Ltd | HSBC | 522 |
| 2.000 | China Shineway Pharmaceutical Group Ltd | Citibank | (234) | 5.000 | Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'H' | HSBC | (312) |
| 1.000 | China Shineway Pharmaceutical Group Ltd | HSBC | (150) | (8.600) | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | Citibank | 1.611 |
| (4.000) | China Southern Airlines Co Ltd 'H' | Citibank | 285 | (35.600) | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | HSBC | 8.144 |
| (10.000) | China Southern Airlines Co Ltd 'H' | HSBC | 945 | 36.000 | CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd* | Citibank | (3.770) |
| 28.000 | China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H' | Citibank | (914) | 34.000 | CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd* | HSBC | (3.513) |
| 18.000 | China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H' | HSBC | (859) | 12.000 | CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd* | JP Morgan | (1.240) |
| 3.000 | China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H' | JP Morgan | (143) | (38.000) | CIFI Holdings Group Co Ltd* | Citibank | 992 |
| (13.600) | China Taiping Insurance Holdings Co Ltd | Citibank | 1.504 | 36.000 | CIMC Enric Holdings Ltd | Citibank | (2.217) |
| (123.000) | China Tobacco International HK Co Ltd | Citibank | 6.394 | 24.000 | CIMC Enric Holdings Ltd | HSBC | (2.105) |
| (67.000) | China Tobacco International HK Co Ltd | JP Morgan | 4.559 | 16.000 | CIMC Enric Holdings Ltd | JP Morgan | (1.404) |
| (672.000) | China Tower Corp Ltd 'H' | Citibank | 5.288 | 6.000 | CITIC Ltd | Citibank | (964) |
| (70.000) | China Tower Corp Ltd 'H' | JP Morgan | 1.146 | 2.000 | CITIC Ltd | HSBC | (388) |
| (58.000) | China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd | Citibank | 2.127 | 39.000 | CITIC Ltd | JP Morgan | (7.576) |
| (38.000) | China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd | HSBC | 3.550 | (81.000) | CITIC Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 19.326 |
| (10.000) | China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd | JP Morgan | 935 | (28.500) | CITIC Securities Co Ltd 'H' | HSBC | 10.438 |
| (398.000) | China Travel International Investment Hong Kong Ltd | Citibank | 5.226 | 14.000 | CITIC Telecom International Holdings Ltd | Citibank | (672) |
| (92.000) | China Travel International Investment Hong Kong Ltd | HSBC | 1.844 | (33.500) | CK Asset Holdings Ltd | Citibank | 12.532 |
| (494.000) | China Travel International Investment Hong Kong Ltd | JP Morgan | 9.909 | (1.500) | CK Asset Holdings Ltd | HSBC | 807 |
| 5.200 | China Vanke Co Ltd 'H' | HSBC | (1.167) | 35.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | Citibank | (16.954) |
| 22.600 | China Vanke Co Ltd 'H' | JP Morgan | (5.075) | 14.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | HSBC | (11.761) |
| (2.000) | China Water Affairs Group Ltd | Citibank | 69 | 21.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | JP Morgan | (17.447) |
| (6.000) | China Water Affairs Group Ltd | JP Morgan | 528 | (1.500) | CLP Holdings Ltd | JP Morgan | 679 |
| 35.500 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | Citibank | (2.258) | (96.000) | C-Mer Eye Care Holdings Ltd | Citibank | 4.381 |
| 26.500 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | HSBC | (3.825) | (104.000) | C-Mer Eye Care Holdings Ltd | JP Morgan | 6.406 |
| | | | | (24.000) | CMGE Technology Group Ltd | Citibank | 471 |
| | | | | (40.000) | CMGE Technology Group Ltd | JP Morgan | 2.072 |
| | | | | 129.000 | CMOC Group Ltd 'H' | Citibank | (2.925) |
| | | | | 66.000 | CMOC Group Ltd 'H' | HSBC | (6.835) |
| | | | | 96.000 | CMOC Group Ltd 'H' | JP Morgan | (9.945) |
| | | | | 63.000 | COFCO Joycome Foods Ltd | Citibank | (1.235) |
| | | | | 8.000 | COFCO Joycome Foods Ltd | HSBC | (167) |
| | | | | 6.000 | COFCO Joycome Foods Ltd | JP Morgan | (158) |
| | | | | (10.000) | Concord New Energy Group Ltd | Citibank | 40 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------|--|---------------|---|-----------|--|---------------|---|
| | Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | |
| 2.320 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (7.410) | 14.000 | Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd | JP Morgan | (510) |
| (60.000) | Convoy Global Holdings Ltd' | Citibank | 1.280 | 45.000 | Far East Horizon Ltd | Citibank | (2.599) |
| (324.000) | Convoy Global Holdings Ltd' | HSBC | 6.894 | 13.000 | Far East Horizon Ltd | HSBC | (1.240) |
| (192.000) | Convoy Global Holdings Ltd' | JP Morgan | — | 43.000 | Far East Horizon Ltd | JP Morgan | (4.102) |
| (100.000) | COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H' | Citibank | 1.045 | 3.800 | FAW Jiefang Group Co Ltd | Goldman Sachs | (112) |
| (57.000) | COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H' | HSBC | 786 | 13.200 | Focus Media Information Technology Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (1.267) |
| (8.000) | COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H' | JP Morgan | 110 | 500 | Fosun International Ltd | JP Morgan | (21) |
| 20.000 | COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H' | Citibank | (1.514) | (18.400) | Fosun Tourism Group | Citibank | 2.618 |
| 50.000 | COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H' | HSBC | (5.914) | (11.800) | Fosun Tourism Group | JP Morgan | 2.809 |
| 12.000 | COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H' | JP Morgan | (1.420) | (100.000) | Fu Shou Yuan International Group Ltd | Citibank | 6.141 |
| 3.350 | COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' | Citibank | (1.106) | (19.000) | Fu Shou Yuan International Group Ltd | JP Morgan | 1.308 |
| 250 | COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' | HSBC | (81) | 100.000 | Fufeng Group Ltd | Citibank | (4.573) |
| 9.150 | COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' | JP Morgan | (2.959) | 8.000 | Fufeng Group Ltd | HSBC | (634) |
| (42.000) | COSCO SHIPPING Ports Ltd | Citibank | 1.659 | 49.000 | Fufeng Group Ltd | JP Morgan | (3.888) |
| (7.000) | Country Garden Holdings Co Ltd | JP Morgan | 542 | 2.000 | Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'H' | Citibank | (729) |
| 1.500 | CSC Financial Co Ltd 'H' | Citibank | (76) | 9.600 | Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'H' | HSBC | (3.852) |
| 6.500 | CSC Financial Co Ltd 'H' | HSBC | (393) | 12.800 | Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (5.139) |
| 500 | CSC Financial Co Ltd 'H' | JP Morgan | (30) | 1.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd | Citibank | (465) |
| 8.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | Citibank | (821) | 5.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd | HSBC | (2.907) |
| 24.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | HSBC | (3.694) | 6.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd | JP Morgan | (3.491) |
| 16.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | JP Morgan | (2.463) | (6.600) | Ganfeng Lithium Group Co Ltd 'H' | Citibank | 3.577 |
| (167.000) | Dali Foods Group Co Ltd | Citibank | 12.486 | (9) | GCL New Energy Holdings Ltd' | JP Morgan | — |
| (46.500) | Dali Foods Group Co Ltd | HSBC | 3.290 | (71.000) | GCL Technology Holdings Ltd | Citibank | 1.117 |
| 103.000 | Digital China Holdings Ltd | Citibank | (997) | (16.000) | GCL Technology Holdings Ltd | JP Morgan | 259 |
| 59.000 | Digital China Holdings Ltd | HSBC | (1.235) | 158.000 | Geely Automobile Holdings Ltd | Citibank | (10.633) |
| 143.000 | Digital China Holdings Ltd | JP Morgan | (2.997) | 6.000 | Geely Automobile Holdings Ltd | HSBC | (523) |
| 5.300 | Dong-E-E-Jiao Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (855) | 48.000 | Geely Automobile Holdings Ltd | JP Morgan | (4.185) |
| 2.000 | Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H' | Citibank | (68) | 14.000 | Genertec Universal Medical Group Co Ltd | Citibank | (498) |
| 14.000 | Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H' | HSBC | (738) | 5.500 | Genertec Universal Medical Group Co Ltd | HSBC | (436) |
| (40.000) | Dongyue Group Ltd | Citibank | 4.359 | 13.500 | Genertec Universal Medical Group Co Ltd | JP Morgan | (1.070) |
| (2.000) | Dongyue Group Ltd | JP Morgan | 316 | (26.000) | Genscript Biotech Corp | Citibank | 7.285 |
| (4.000) | East Buy Holding Ltd | Citibank | (1.687) | (2.000) | Genscript Biotech Corp | HSBC | 955 |
| (2.500) | East Buy Holding Ltd | JP Morgan | (1.051) | (39.600) | GF Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 3.137 |
| (45.000) | EC Healthcare | Citibank | 1.769 | (20.000) | Golden Solar New Energy Technology Holdings Ltd | Citibank | (356) |
| (3.000) | EC Healthcare | JP Morgan | 410 | (72.000) | Golden Solar New Energy Technology Holdings Ltd | JP Morgan | 10.638 |
| (438.000) | E-Commodities Holdings Ltd | Citibank | 2.352 | 7.500 | Great Wall Motor Co Ltd 'H' | Citibank | (1.261) |
| (368.000) | E-Commodities Holdings Ltd | JP Morgan | 11.164 | 2.500 | Great Wall Motor Co Ltd 'H' | HSBC | (425) |
| (3.300) | ENN Energy Holdings Ltd | Citibank | 7.665 | 8.000 | Great Wall Motor Co Ltd 'H' | JP Morgan | (1.362) |
| (1.400) | ENN Energy Holdings Ltd | HSBC | 3.717 | 22.700 | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A' | Goldman Sachs | (7.347) |
| 5.200 | ESR Group Ltd | Citibank | (147) | 1.500 | Greentown China Holdings Ltd | JP Morgan | (458) |
| 1.800 | ESR Group Ltd | HSBC | (147) | (5.000) | Greentown Management Holdings Co Ltd | Citibank | 602 |
| 7.400 | ESR Group Ltd | JP Morgan | (604) | (1.000) | Greentown Management Holdings Co Ltd | JP Morgan | 76 |
| 4.000 | Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd | Citibank | (58) | | | | |
| 44.000 | Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd | HSBC | (1.602) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|---------------|---|-----------------------------|---|---------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| (32.000) | Greentown Service Group Co Ltd | Citibank | 890 | 23.000 | Hang Lung Group Ltd | JP Morgan | (5.216) |
| (14.000) | Greentown Service Group Co Ltd | HSBC | 647 | (46.000) | Hang Lung Properties Ltd | Citibank | 2.130 |
| 1.300 | Guangdong Haid Group Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (1.195) | (4.300) | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | Citibank | 2.780 |
| 128.000 | Guangshen Railway Co Ltd 'H' | Citibank | (2.519) | (400) | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | HSBC | 351 |
| 66.000 | Guangshen Railway Co Ltd 'H' | HSBC | 706 | (200) | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | JP Morgan | 176 |
| 48.000 | Guangshen Railway Co Ltd 'H' | JP Morgan | 577 | (24.000) | Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd | Citibank | 624 |
| 28.000 | Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H' | Citibank | (1.175) | (6.000) | Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd | HSBC | 976 |
| 48.000 | Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H' | HSBC | (2.153) | 23.000 | HBM Holdings Ltd | Citibank | (185) |
| 46.000 | Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (2.065) | 38.000 | HBM Holdings Ltd | HSBC | (1.002) |
| (2.000) | Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H' | Citibank | (116) | 38.000 | HBM Holdings Ltd | JP Morgan | (1.003) |
| (4.000) | Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H' | HSBC | 180 | 500 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | Citibank | (74) |
| 37.600 | Guangzhou R&F Properties Co Ltd 'H' | Citibank | (779) | 9.000 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | HSBC | (2.593) |
| 33.200 | Guangzhou R&F Properties Co Ltd 'H' | HSBC | (1.303) | 7.000 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | JP Morgan | (2.017) |
| 16.000 | Guangzhou R&F Properties Co Ltd 'H' | JP Morgan | (628) | (14.000) | Helens International Holdings Co Ltd | Citibank | 2.266 |
| (1.200) | Guotai Junan Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 35 | (7.500) | Helens International Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.098 |
| (7.000) | Guotai Junan Securities Co Ltd 'H' | HSBC | 805 | 6.500 | Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.712) |
| 16.000 | Haichang Ocean Park Holdings Ltd | JP Morgan | 67 | (16.000) | Henderson Land Development Co Ltd | Citibank | 4.899 |
| 6.000 | Haidilao International Holding Ltd | HSBC | (1.277) | (5.000) | Henderson Land Development Co Ltd | HSBC | 2.520 |
| (7.600) | Haier Smart Home Co Ltd 'H' | Citibank | 1.302 | (19.000) | Henderson Land Development Co Ltd | JP Morgan | 9.581 |
| (3.200) | Haier Smart Home Co Ltd 'H' | HSBC | 738 | (500) | Hengan International Group Co Ltd | Citibank | 170 |
| (23.000) | Hainan Meilan International Airport Co Ltd 'H' | Citibank | 4.069 | (4.500) | Hengan International Group Co Ltd | JP Morgan | 827 |
| (4.000) | Hainan Meilan International Airport Co Ltd 'H' | HSBC | 1.415 | 29.800 | Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (4.064) |
| (2.000) | Hainan Meilan International Airport Co Ltd 'H' | JP Morgan | 708 | 4.000 | Hisense Home Appliances Group Co Ltd 'H' | Citibank | (659) |
| 1.273.000 | Haitong International Securities Group Ltd | Citibank | (192) | 3.000 | Hisense Home Appliances Group Co Ltd 'H' | HSBC | (632) |
| 7.000 | Haitong International Securities Group Ltd | HSBC | (35) | 2.000 | Hisense Home Appliances Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (421) |
| 903.000 | Haitong International Securities Group Ltd | JP Morgan | (4.471) | 223.000 | HKBN Ltd | Citibank | (9.666) |
| 381.900 | Haitong International Securities Group Ltd (Right) | Citibank | 487 | 500 | HKBN Ltd | HSBC | (51) |
| 2.100 | Haitong International Securities Group Ltd (Right) | HSBC | 3 | 117.000 | HKBN Ltd | JP Morgan | (11.947) |
| 270.900 | Haitong International Securities Group Ltd (Right) | JP Morgan | 346 | (14.000) | HKT Trust & HKT Ltd (Unit) | Citibank | 462 |
| (2.800) | Haitong Securities Co Ltd 'H' | Citibank | 79 | (8.000) | HKT Trust & HKT Ltd (Unit) | HSBC | 288 |
| (41.600) | Haitong Securities Co Ltd 'H' | JP Morgan | 3.186 | (152.000) | Hong Kong & China Gas Co Ltd | Citibank | 6.384 |
| 14.000 | Hang Lung Group Ltd | Citibank | (1.577) | 1.200 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | Citibank | (3.301) |
| 1.000 | Hang Lung Group Ltd | HSBC | (227) | 134.000 | Hope Education Group Co Ltd | Citibank | (360) |
| | | | | 32.000 | Hope Education Group Co Ltd | HSBC | (103) |
| | | | | 168.000 | Hope Education Group Co Ltd | JP Morgan | (1.501) |
| | | | | 3.400 | Hopson Development Holdings Ltd | Citibank | (131) |
| | | | | 1.200 | Hopson Development Holdings Ltd | HSBC | (46) |
| | | | | 2.800 | Hopson Development Holdings Ltd | JP Morgan | (107) |
| | | | | (11.000) | Hua Hong Semiconductor Ltd | Citibank | 2.736 |
| | | | | (14.200) | Huaxin Cement Co Ltd 'H' | Citibank | 1.655 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|---------------|---|-----------------------------|---|---------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| (88.700) | Huaxin Cement Co Ltd 'H' | JP Morgan | 15.535 | (9.500) | Jinxin Fertility Group Ltd | Citibank | 507 |
| 19.300 | Huitongda Network Co Ltd 'H' | Citibank | (3.334) | (21.500) | Jinxin Fertility Group Ltd | HSBC | 2.912 |
| 700 | Huitongda Network Co Ltd 'H' | HSBC | (259) | (3.500) | Jinxin Fertility Group Ltd | JP Morgan | 474 |
| 4.200 | Huitongda Network Co Ltd 'H' | JP Morgan | (1.552) | 4.000 | Jiumaojiu International Holdings Ltd | HSBC | (966) |
| 9.800 | Hunan Valin Steel Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (412) | 50.500 | Johnson Electric Holdings Ltd | Citibank | (46) |
| 7.500 | HUTCHMED China Ltd | Citibank | (1.567) | 28.500 | Johnson Electric Holdings Ltd | HSBC | 3.113 |
| 500 | HUTCHMED China Ltd | HSBC | (358) | 25.000 | Johnson Electric Holdings Ltd | JP Morgan | 2.729 |
| 2.000 | HUTCHMED China Ltd | JP Morgan | (1.432) | 1.100 | Joinn Laboratories China Co Ltd 'H' | Citibank | (246) |
| (3.400) | Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd | JP Morgan | 3.323 | 700 | Joinn Laboratories China Co Ltd 'H' | HSBC | (366) |
| (29.000) | Hysan Development Co Ltd | Citibank | 5.472 | 3.220 | Joinn Laboratories China Co Ltd 'H' | JP Morgan | (1.683) |
| (3.000) | Hysan Development Co Ltd | HSBC | 1.168 | (31.500) | Kerry Properties Ltd | Citibank | 5.843 |
| (91.000) | IGG Inc | Citibank | 2.262 | 2.500 | Keymed Biosciences Inc | Citibank | (5.090) |
| (13.000) | IGG Inc | JP Morgan | 3.666 | 1.000 | Keymed Biosciences Inc | HSBC | (2.845) |
| 8.000 | InnoCare Pharma Ltd | Citibank | (586) | 2.000 | Kingboard Holdings Ltd | Citibank | (534) |
| 6.000 | InnoCare Pharma Ltd | HSBC | (1.252) | 3.000 | Kingboard Holdings Ltd | HSBC | (1.285) |
| 2.000 | InnoCare Pharma Ltd | JP Morgan | (417) | 1.500 | Kingboard Holdings Ltd | JP Morgan | (643) |
| (1.500) | Innovent Biologics Inc | Citibank | 425 | (37.500) | Kingboard Laminates Holdings Ltd | Citibank | 3.466 |
| (1.000) | Innovent Biologics Inc | HSBC | 552 | (20.000) | Kingboard Laminates Holdings Ltd | HSBC | 2.337 |
| (1.000) | Innovent Biologics Inc | JP Morgan | 553 | (4.500) | Kingboard Laminates Holdings Ltd | JP Morgan | 526 |
| 16.000 | Inspur Digital Enterprise Technology Ltd | Citibank | (604) | 5.000 | Kingdee International Software Group Co Ltd | Citibank | (766) |
| 4.000 | Inspur Digital Enterprise Technology Ltd | HSBC | (334) | 3.000 | Kingdee International Software Group Co Ltd | HSBC | (452) |
| 10.000 | Inspur Digital Enterprise Technology Ltd | JP Morgan | (834) | 12.000 | Kingdee International Software Group Co Ltd | JP Morgan | (1.807) |
| (16.000) | Intron Technology Holdings Ltd | JP Morgan | 1.391 | 2.200 | Kingsoft Corp Ltd | Citibank | (549) |
| 16.100 | JA Solar Technology Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (5.604) | 8.600 | Kingsoft Corp Ltd | HSBC | (4.985) |
| (11.600) | JD Health International Inc | Citibank | 3.836 | 6.200 | Kingsoft Corp Ltd | JP Morgan | (3.595) |
| (50) | JD Health International Inc | HSBC | 47 | 1.000 | Kuaishou Technology | Citibank | (76) |
| (450) | JD Health International Inc | JP Morgan | 420 | 800 | Kuaishou Technology | HSBC | 127 |
| 3.000 | JD Logistics Inc | Citibank | (139) | 3.400 | Kuaishou Technology | JP Morgan | 538 |
| 22.900 | JD Logistics Inc | HSBC | 65 | (14.000) | Kunlun Energy Co Ltd | Citibank | 1.273 |
| 2.800 | JD Logistics Inc | JP Morgan | 8 | (4.000) | Kunlun Energy Co Ltd | HSBC | 657 |
| 6.050 | JD.com Inc 'A' | Citibank | (11.160) | (2.000) | Kunlun Energy Co Ltd | JP Morgan | 329 |
| 3.000 | JD.com Inc 'A' | HSBC | (5.113) | 38.000 | KWG Living Group Holdings Ltd | Citibank | 9 |
| 2.850 | JD.com Inc 'A' | JP Morgan | (4.860) | 26.000 | KWG Living Group Holdings Ltd | HSBC | (54) |
| (66.000) | Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | Citibank | 5.685 | 2.800 | LB Group Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (834) |
| (20.000) | Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | HSBC | 2.387 | 22.000 | Lenovo Group Ltd | Citibank | (1.725) |
| (2.000) | Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | JP Morgan | 239 | 4.000 | Lenovo Group Ltd | HSBC | (294) |
| 1.000 | Jiangsu Recbio Technology Co Ltd 'H' | Citibank | 46 | 40.000 | Lenovo Group Ltd | JP Morgan | (2.942) |
| 1.000 | Jiangsu Recbio Technology Co Ltd 'H' | HSBC | (278) | (3.100) | Li Auto Inc 'A' | Citibank | 1.428 |
| 1.500 | Jiangsu Recbio Technology Co Ltd 'H' | JP Morgan | (416) | (500) | Li Auto Inc 'A' | HSBC | (1.058) |
| 12.400 | Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | 224 | (6.100) | Li Auto Inc 'A' | JP Morgan | (12.900) |
| 9.000 | Jiangxi Copper Co Ltd 'H' | Citibank | (1.083) | (28.000) | Li Ning Co Ltd | Citibank | 28.376 |
| 47.000 | Jiangxi Copper Co Ltd 'H' | HSBC | (16.403) | (7.000) | Li Ning Co Ltd | HSBC | 11.439 |
| 27.000 | Jiangxi Copper Co Ltd 'H' | JP Morgan | (9.426) | 212.000 | Liaoning Port Co Ltd 'H' | Citibank | (576) |
| 291.000 | Jinchuan Group International Resources Co Ltd | Citibank | (2.632) | 18.000 | Liaoning Port Co Ltd 'H' | HSBC | (112) |
| 138.000 | Jinchuan Group International Resources Co Ltd | HSBC | (2.361) | 100.000 | Liaoning Port Co Ltd 'H' | JP Morgan | (622) |
| 350.000 | Jinchuan Group International Resources Co Ltd | JP Morgan | (5.989) | (50.000) | Lifetech Scientific Corp | Citibank | 1.237 |
| | | | | (44.000) | Lifetech Scientific Corp | HSBC | 1.939 |
| | | | | (228.000) | Lifetech Scientific Corp | JP Morgan | 10.052 |
| | | | | 47.300 | Lingyi iTech Guangdong Co 'A' | Goldman Sachs | 1.386 |
| | | | | 8.900 | Link (REIT) | Citibank | (4.531) |
| | | | | 1.400 | Link (REIT) | HSBC | (1.154) |
| | | | | 29.500 | Link (REIT) | JP Morgan | (24.327) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 3.100 | Livzon Pharmaceutical Group Inc 'H' | Citibank | (357) | 500 | NetDragon Websoft Holdings Ltd | HSBC | (68) |
| 3.100 | Livzon Pharmaceutical Group Inc 'H' | HSBC | (612) | 8.000 | NetDragon Websoft Holdings Ltd | JP Morgan | (1.096) |
| 1.400 | Livzon Pharmaceutical Group Inc 'H' | JP Morgan | (277) | (5.000) | NetEase Inc | Citibank | 4.883 |
| (25.000) | LK Technology Holdings Ltd | Citibank | 3.237 | (1.100) | NetEase Inc | HSBC | 1.130 |
| (5.000) | LK Technology Holdings Ltd | JP Morgan | 438 | (1.200) | NetEase Inc | JP Morgan | 1.234 |
| 426.000 | Lonking Holdings Ltd | Citibank | (13.731) | 11.700 | New China Life Insurance Co Ltd 'H' | Citibank | (3.047) |
| 522.000 | Lonking Holdings Ltd | HSBC | (18.908) | 17.000 | New China Life Insurance Co Ltd 'H' | HSBC | (9.453) |
| 219.000 | Lonking Holdings Ltd | JP Morgan | (8.038) | 13.700 | New China Life Insurance Co Ltd 'H' | JP Morgan | (7.620) |
| (8.000) | Luk Fook Holdings International Ltd | Citibank | 2.085 | (1.000) | New Horizon Health Ltd | Citibank | (185) |
| 5.500 | Luye Pharma Group Ltd | Citibank | (25) | (5.000) | New Horizon Health Ltd | JP Morgan | 256 |
| 2.500 | Luye Pharma Group Ltd | HSBC | (122) | 5.200 | New Oriental Education & Technology Group Inc | Citibank | (435) |
| 48.000 | Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H' | Citibank | (814) | 1.100 | New Oriental Education & Technology Group Inc | HSBC | (357) |
| 64.000 | Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H' | HSBC | (2.752) | 1.800 | New Oriental Education & Technology Group Inc | JP Morgan | (585) |
| 80.000 | Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H' | JP Morgan | (3.441) | 16.000 | New World Development Co Ltd | Citibank | (1.623) |
| 19.200 | Man Wah Holdings Ltd | Citibank | (882) | 9.000 | New World Development Co Ltd | HSBC | (2.714) |
| 14.800 | Man Wah Holdings Ltd | HSBC | (2.302) | 10.000 | New World Development Co Ltd | JP Morgan | (3.017) |
| 12.800 | Man Wah Holdings Ltd | JP Morgan | (1.992) | (6.000) | Newborn Town Inc | Citibank | 148 |
| (51.800) | Maoyan Entertainment | Citibank | 6.038 | (24.000) | Newborn Town Inc | JP Morgan | 1.216 |
| (1.600) | Maoyan Entertainment | JP Morgan | 405 | 6.000 | Nine Dragons Paper Holdings Ltd | HSBC | (1.034) |
| (1.200) | MECOM Power and Construction Ltd | Citibank | 4 | 9.000 | Nine Dragons Paper Holdings Ltd | JP Morgan | (1.551) |
| (140.500) | Meitu Inc | Citibank | 1.136 | (16.000) | Nissin Foods Co Ltd | Citibank | 4 |
| (98.000) | Meitu Inc | JP Morgan | 2.334 | (6.000) | Nissin Foods Co Ltd | JP Morgan | 20 |
| 400 | Meituan 'B' | Citibank | (1.156) | (4.400) | Nongfu Spring Co Ltd 'H' | Citibank | 689 |
| 2.400 | Meituan 'B' | HSBC | (7.279) | (800) | Nongfu Spring Co Ltd 'H' | HSBC | 69 |
| 1.300 | Meituan 'B' | JP Morgan | (3.944) | (5.800) | Nongfu Spring Co Ltd 'H' | JP Morgan | 501 |
| 5.000 | Metallurgical Corp of China Ltd 'H' | Citibank | (85) | (1.000) | NWS Holdings Ltd | Citibank | 41 |
| 144.000 | Metallurgical Corp of China Ltd 'H' | HSBC | (9.845) | (51.000) | NWS Holdings Ltd | HSBC | 4.344 |
| 44.000 | Metallurgical Corp of China Ltd 'H' | JP Morgan | (3.009) | (4.000) | Onowo Inc 'H' | JP Morgan | 3.734 |
| 14.000 | MGM China Holdings Ltd | Citibank | (832) | (7.000) | Orient Overseas International Ltd | Citibank | 51.400 |
| 15.600 | MGM China Holdings Ltd | HSBC | (1.934) | 62.800 | Orient Securities Co Ltd 'H' | Citibank | (3.433) |
| 21.200 | MGM China Holdings Ltd | JP Morgan | (3.150) | 16.400 | Orient Securities Co Ltd 'H' | HSBC | (1.802) |
| (27.000) | Microport Cardioflow Medtech Corp | Citibank | 1.461 | 152.000 | Orient Securities Co Ltd 'H' | JP Morgan | (16.461) |
| (12.000) | Microport Cardioflow Medtech Corp | HSBC | 928 | (186.000) | Pacific Basin Shipping Ltd | Citibank | 4.141 |
| (10.000) | Microport Cardioflow Medtech Corp | JP Morgan | 598 | (10.000) | Pacific Basin Shipping Ltd | HSBC | 479 |
| (2.400) | Microport Scientific Corp | Citibank | 498 | (127.000) | Pacific Basin Shipping Ltd | JP Morgan | 6.086 |
| 4.000 | Minth Group Ltd | Citibank | (847) | (45.000) | Pacific Textiles Holdings Ltd | Citibank | 1.117 |
| 2.000 | Minth Group Ltd | HSBC | (646) | (54.000) | Pacific Textiles Holdings Ltd | HSBC | 2.105 |
| 6.000 | Minth Group Ltd | JP Morgan | (1.939) | (4.000) | Pacific Textiles Holdings Ltd | JP Morgan | 156 |
| 4.000 | MMG Ltd | Citibank | (125) | (26.000) | PCCW Ltd | Citibank | 290 |
| 4.000 | MMG Ltd | HSBC | (319) | (12.000) | Peijia Medical Ltd | Citibank | 1.676 |
| 76.000 | MMG Ltd | JP Morgan | (6.062) | 21.000 | People's Insurance Co Group of China Ltd 'H' | HSBC | (896) |
| 4.000 | Modern Dental Group Ltd | Citibank | (43) | 57.000 | People's Insurance Co Group of China Ltd 'H' | JP Morgan | (2.432) |
| 5.000 | Modern Dental Group Ltd | HSBC | (48) | 5.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | JP Morgan | (7.241) |
| 10.000 | Modern Dental Group Ltd | JP Morgan | 19 | (127.000) | Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' | Citibank | 3.066 |
| 4.000 | Morimatsu International Holdings Co Ltd | Citibank | (630) | (106.000) | Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' | JP Morgan | 8.260 |
| 2.000 | Morimatsu International Holdings Co Ltd | HSBC | (389) | (38.000) | Power Assets Holdings Ltd | Citibank | 6.097 |
| 35.000 | Morimatsu International Holdings Co Ltd | JP Morgan | (6.816) | (9.000) | Power Assets Holdings Ltd | HSBC | 4.902 |
| 3.500 | MTR Corp Ltd | HSBC | (1.599) | (2.000) | Power Assets Holdings Ltd | JP Morgan | 1.089 |
| 1.500 | Nayuki Holdings Ltd | Citibank | (175) | 13.000 | Powerlong Commercial Management Holdings Ltd | Citibank | (444) |
| 5.500 | Nayuki Holdings Ltd | JP Morgan | (735) | | | | |
| 1.500 | NetDragon Websoft Holdings Ltd | Citibank | (105) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------|--|---------------|---|-----------|---|---------------|---|
| | Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | |
| 14.500 | Powerlong Commercial Management Holdings Ltd | HSBC | (1.086) | 17.500 | Shenzhen International Holdings Ltd | Citibank | (1.345) |
| 5.500 | Powerlong Commercial Management Holdings Ltd | JP Morgan | (640) | 1.500 | Shenzhen International Holdings Ltd | JP Morgan | (187) |
| 35.000 | Powerlong Real Estate Holdings Ltd | Citibank | (499) | 8.000 | Shenzhen Investment Ltd | Citibank | (125) |
| 22.000 | Powerlong Real Estate Holdings Ltd | HSBC | (865) | 42.000 | Shenzhen Investment Ltd | HSBC | (897) |
| 74.000 | Powerlong Real Estate Holdings Ltd | JP Morgan | (2.909) | 5.400 | Shenzhen Kstar Science And Technology Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (4.208) |
| 2.700 | PRADA SpA | Citibank | (2.346) | 2.000 | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (4.688) |
| 3.700 | PRADA SpA | HSBC | (2.337) | 1.200 | Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | 607 |
| 2.100 | PRADA SpA | JP Morgan | (1.327) | 50.900 | Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.120) |
| (22.000) | Realord Group Holdings Ltd | Citibank | 55 | 9.558 | Shenzhen SC New Energy Technology Corp 'A' | Goldman Sachs | (16.110) |
| (14.000) | Realord Group Holdings Ltd | JP Morgan | 73 | 10.400 | Shenzhen YUTO Packaging Technology Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (3.417) |
| 12.600 | Risen Energy Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (1.614) | 14.500 | Shimao Group Holdings Ltd' | Citibank | (5.805) |
| 48.000 | Sa Sa International Holdings Ltd | Citibank | (1.979) | 2.500 | Shimao Group Holdings Ltd' | HSBC | (996) |
| 94.000 | Sa Sa International Holdings Ltd | HSBC | (4.044) | 16.000 | Shimao Group Holdings Ltd' | JP Morgan | 2.638 |
| 22.000 | Sa Sa International Holdings Ltd | JP Morgan | (947) | 132.000 | Shougang Fushan Resources Group Ltd | Citibank | (5.812) |
| 2.400 | Sands China Ltd | HSBC | (216) | 8.000 | Shougang Fushan Resources Group Ltd | HSBC | (352) |
| 3.600 | Sands China Ltd | JP Morgan | (324) | 16.000 | Shougang Fushan Resources Group Ltd | JP Morgan | (705) |
| (84.000) | Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd | Citibank | 6.858 | 21.500 | Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (1.258) |
| (3.000) | Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd | JP Morgan | 169 | 57.000 | Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd | Citibank | (301) |
| 27.000 | S-Enjoy Service Group Co Ltd | Citibank | (1.335) | 77.000 | Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd | HSBC | (674) |
| 15.000 | S-Enjoy Service Group Co Ltd | HSBC | (1.739) | 196.000 | Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd | JP Morgan | (1.716) |
| 19.000 | S-Enjoy Service Group Co Ltd | JP Morgan | (2.284) | (201.000) | Sino Biopharmaceutical Ltd | Citibank | 7.111 |
| 13.400 | SF Holding Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (7.843) | (4.000) | Sino Biopharmaceutical Ltd | HSBC | 267 |
| 9.500 | Shandong Gold Mining Co Ltd 'H' | JP Morgan | (3.455) | (8.000) | Sino Biopharmaceutical Ltd | JP Morgan | 534 |
| (61.200) | Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd 'H' | Citibank | 4.858 | (41.810) | Sino Land Co Ltd | Citibank | 1.380 |
| (400) | Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd 'H' | JP Morgan | 96 | (26.491) | Sino Land Co Ltd | HSBC | 884 |
| 2.500 | Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'H' | Citibank | (172) | (399) | Sino Land Co Ltd | JP Morgan | 13 |
| 1.500 | Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'H' | HSBC | (251) | 12.000 | Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H' | Citibank | (761) |
| 3.000 | Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (502) | 500 | Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H' | HSBC | (49) |
| (5.000) | Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd 'H' | Citibank | (8) | 81.000 | Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (7.888) |
| (11.000) | Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | 1.070 | 44.000 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H' | Citibank | (519) |
| 200 | Shanghai Haohai Biological Technology Co Ltd 'H' | Citibank | (145) | 8.000 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H' | HSBC | (151) |
| 100 | Shanghai Haohai Biological Technology Co Ltd 'H' | HSBC | (89) | 38.000 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H' | JP Morgan | (716) |
| 800 | Shanghai Haohai Biological Technology Co Ltd 'H' | JP Morgan | (713) | 8.000 | Sinopharm Group Co Ltd 'H' | Citibank | (1.326) |
| (6.900) | Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H' | Citibank | 183 | 1.200 | Sinopharm Group Co Ltd 'H' | HSBC | (268) |
| 61.200 | Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.304) | 8.000 | Sinopharm Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (1.790) |
| 4.100 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | 195 | 35.500 | Sinotruk Hong Kong Ltd | Citibank | (4.266) |
| | | | | 12.000 | Sinotruk Hong Kong Ltd | HSBC | (3.696) |
| | | | | 27.000 | Sinotruk Hong Kong Ltd | JP Morgan | (10.875) |
| | | | | (52.000) | SITC International Holdings Co Ltd | Citibank | (1.434) |
| | | | | (1.000) | SITC International Holdings Co Ltd | HSBC | (8) |
| | | | | (13.000) | SITC International Holdings Co Ltd | JP Morgan | (105) |
| | | | | (415.000) | SJM Holdings Ltd | Citibank | 15.097 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|---------------|---|-----------------------------|--|---------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| (7.500) | SJM Holdings Ltd | JP Morgan | 544 | (76.000) | Towngas Smart Energy Co Ltd | Citibank | 3.268 |
| (68.000) | Skyworth Group Ltd | Citibank | 408 | (14.000) | Towngas Smart Energy Co Ltd | JP Morgan | 388 |
| (22.000) | Skyworth Group Ltd | HSBC | 149 | (40.000) | TravelSky Technology Ltd 'H' | Citibank | 2.381 |
| (20.000) | Skyworth Group Ltd | JP Morgan | 136 | (1.000) | TravelSky Technology Ltd 'H' | HSBC | 88 |
| (96.000) | SMI Holding Group Ltd TM | Citibank | — | 136.000 | Truly International Holdings Ltd | Citibank | (1.069) |
| (216.000) | SMI Holding Group Ltd TM | JP Morgan | — | 58.000 | Truly International Holdings Ltd | HSBC | (1.024) |
| 2.000 | SSY Group Ltd | Citibank | (51) | 94.000 | Truly International Holdings Ltd | JP Morgan | (1.660) |
| 8.000 | SSY Group Ltd | HSBC | (348) | 2.000 | Tsingtao Brewery Co Ltd 'H' | Citibank | (2.141) |
| 6.000 | SSY Group Ltd | JP Morgan | (261) | 2.000 | Tsingtao Brewery Co Ltd 'H' | HSBC | (1.977) |
| 22.000 | Sun Art Retail Group Ltd | Citibank | (797) | 6.000 | Tsingtao Brewery Co Ltd 'H' | JP Morgan | (5.237) |
| 19.000 | Sun Art Retail Group Ltd | HSBC | (3.551) | 2.000 | Uni-President China Holdings Ltd | Citibank | (49) |
| 132.500 | Sun Art Retail Group Ltd | JP Morgan | (24.764) | 12.000 | Uni-President China Holdings Ltd | HSBC | (960) |
| (13.500) | Sun Hung Kai Properties Ltd | Citibank | 8.076 | 3.000 | Uni-President China Holdings Ltd | JP Morgan | (240) |
| (10.500) | Sun Hung Kai Properties Ltd | HSBC | 13.408 | (11.000) | United Co RUSAL International PJSC | Citibank | 261 |
| 4.000 | Sunac Services Holdings Ltd | Citibank | (114) | 50.000 | United Laboratories International Holdings Ltd | Citibank | 2.479 |
| 6.000 | Sunac Services Holdings Ltd | HSBC | (117) | 8.000 | United Laboratories International Holdings Ltd | HSBC | (69) |
| 9.000 | Sunac Services Holdings Ltd | JP Morgan | (753) | 72.000 | United Laboratories International Holdings Ltd | JP Morgan | (624) |
| (51.000) | SUNeVision Holdings Ltd | Citibank | 701 | (1.000) | Value Partners Group Ltd | Citibank | 9 |
| 2.000 | Sungrow Power Supply Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.556) | (17.000) | Value Partners Group Ltd | HSBC | 988 |
| 1.400 | Sunny Optical Technology Group Co Ltd | Citibank | (1.474) | (20.000) | Value Partners Group Ltd | JP Morgan | 1.163 |
| 2.300 | Sunny Optical Technology Group Co Ltd | HSBC | (2.599) | (26.500) | Venus MedTech Hangzhou Inc 'H' | Citibank | 4.314 |
| 2.100 | Sunny Optical Technology Group Co Ltd | JP Morgan | (2.374) | (4.000) | Venus MedTech Hangzhou Inc 'H' | JP Morgan | 1.548 |
| 31.600 | Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | 1.639 | (22.000) | Vinda International Holdings Ltd | Citibank | 5.046 |
| 960 | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.554) | 2.000 | Vitasoy International Holdings Ltd | Citibank | (93) |
| 1.000 | Swire Pacific Ltd 'A' | Citibank | (543) | (1.000.000) | Viva Goods Company Ltd | Citibank | 13.055 |
| 1.500 | Swire Pacific Ltd 'A' | JP Morgan | (1.808) | (40.000) | Viva Goods Company Ltd | JP Morgan | 856 |
| 35.000 | Swire Properties Ltd | Citibank | (6.818) | (37.000) | Vobile Group Ltd | Citibank | 1.249 |
| 25.600 | Swire Properties Ltd | HSBC | (8.340) | (149.000) | Vobile Group Ltd | JP Morgan | 13.406 |
| 24.200 | Swire Properties Ltd | JP Morgan | (7.887) | 6.800 | Wanda Film Holding Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.104) |
| (75.000) | SY Holdings Group Ltd | Citibank | 4.127 | (15.000) | Want Want China Holdings Ltd | Citibank | (78) |
| (7.000) | SY Holdings Group Ltd | JP Morgan | 375 | (49.000) | Weichai Power Co Ltd 'H' | Citibank | 6.886 |
| 14.000 | TCL Electronics Holdings Ltd | Citibank | (476) | (8.000) | Weichai Power Co Ltd 'H' | JP Morgan | 2.673 |
| (2.000) | Techtronic Industries Co Ltd | Citibank | 1.683 | (2.600) | Weilong Delicious Global Holdings Ltd | Citibank | 241 |
| 2.300 | Tencent Holdings Ltd | Citibank | (8.869) | (1.800) | Weilong Delicious Global Holdings Ltd | JP Morgan | 164 |
| 2.000 | Tencent Holdings Ltd | HSBC | (6.782) | (55.000) | Weimob Inc | JP Morgan | 2.199 |
| 3.000 | Tencent Holdings Ltd | JP Morgan | (11.340) | (508.000) | West China Cement Ltd | Citibank | 10.490 |
| (540.000) | Theme International Holdings Ltd | Citibank | 4.257 | (44.000) | West China Cement Ltd | JP Morgan | 1.001 |
| (24.000) | Tianjin Capital Environmental Protection Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | 810 | 23.500 | WH Group Ltd | Citibank | (713) |
| 4.000 | Tianneng Power International Ltd | Citibank | (796) | 19.000 | WH Group Ltd | HSBC | (854) |
| 2.000 | Tianneng Power International Ltd | HSBC | (317) | 50.500 | WH Group Ltd | JP Morgan | (2.271) |
| 62.000 | Tianneng Power International Ltd | JP Morgan | (9.832) | 3.000 | Wharf Holdings Ltd | Citibank | (295) |
| (6.000) | Tingyi Cayman Islands Holding Corp | Citibank | 584 | 2.000 | Wharf Holdings Ltd | HSBC | (375) |
| (10.000) | Tingyi Cayman Islands Holding Corp | JP Morgan | 2.319 | 5.000 | Wharf Holdings Ltd | JP Morgan | (938) |
| 1.000 | Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H' | HSBC | (206) | (22.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Citibank | 4.977 |
| 1.000 | Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H' | JP Morgan | (206) | (3.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | JP Morgan | 1.255 |
| (60.000) | Topsports International Holdings Ltd | Citibank | 5.991 | 8.800 | Wuliangye Yibin Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (18.946) |
| (15.000) | Topsports International Holdings Ltd | HSBC | 1.374 | 536 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | Citibank | (354) |
| (1.000) | Topsports International Holdings Ltd | JP Morgan | 92 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|---------------|---|-----------------------------|---|---------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 60 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | HSBC | (53) | 22.070 | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (11.242) |
| 80 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | JP Morgan | (70) | | | | |
| (1.000) | Wuxi Biologics Cayman Inc | Citibank | 585 | 13.600 | Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H' | Citibank | (1.828) |
| (1.000) | Wuxi Biologics Cayman Inc | HSBC | 927 | | | | |
| (500) | Wuxi Biologics Cayman Inc | JP Morgan | 464 | 3.400 | Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H' | HSBC | (597) |
| 4.200 | XD Inc | Citibank | (718) | 2.400 | Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H' | JP Morgan | (371) |
| 54.000 | Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd | Citibank | (4.818) | (15.800) | ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd 'H' | Citibank | 5.030 |
| 47.500 | Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd | HSBC | (4.851) | (11.400) | ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd 'H' | HSBC | 5.608 |
| 39.500 | Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd | JP Morgan | (4.230) | (24.500) | Zhongsheng Group Holdings Ltd | Citibank | 12.694 |
| (68.000) | Xiaomi Corp 'B' | Citibank | 5.552 | (4.000) | Zhongsheng Group Holdings Ltd | HSBC | 2.573 |
| (3.200) | Xiaomi Corp 'B' | JP Morgan | 474 | (152.000) | Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd | Citibank | 7.880 |
| (29.200) | Xinte Energy Co Ltd 'H' | Citibank | 1.082 | (4.500) | Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd | JP Morgan | 232 |
| (1.600) | Xinte Energy Co Ltd 'H' | HSBC | 581 | 81.954 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (2.500) |
| (366.429) | Xinyi Energy Holdings Ltd | Citibank | 4.593 | 2.000 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' | Citibank | (86) |
| (75.236) | Xinyi Energy Holdings Ltd | HSBC | (249) | 1.800 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' | HSBC | (216) |
| (109.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | Citibank | 7.815 | 64.600 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' | JP Morgan | (7.768) |
| (1.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | HSBC | 296 | 200 | ZTE Corp 'H' | JP Morgan | (1) |
| (25.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | JP Morgan | 7.391 | | | | (387.224) |
| (1.600) | XPeng Inc 'A' | Citibank | 1.157 | Indonesien | | | |
| (2.100) | XPeng Inc 'A' | JP Morgan | 2.755 | 1.045.000 | Ace Hardware Indonesia Tbk PT | Citibank | 179 |
| 8.500 | Xtep International Holdings Ltd | HSBC | (1.436) | 161.000 | Ace Hardware Indonesia Tbk PT | HSBC | 1.181 |
| 500 | Yangtze Optical Fibre & Cable Joint Stock Ltd Co 'H' | Citibank | (24) | 1.385.000 | Ace Hardware Indonesia Tbk PT | JP Morgan | 7.798 |
| 1.600 | Yeahka Ltd | Citibank | (273) | 1.107.100 | AKR Corporindo Tbk PT | Citibank | 67 |
| 400 | Yeahka Ltd | HSBC | (57) | 254.100 | AKR Corporindo Tbk PT | HSBC | (2.877) |
| (28.600) | YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd 'H' | Citibank | 701 | 1.223.900 | AKR Corporindo Tbk PT | JP Morgan | (14.069) |
| (1.000) | YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd 'H' | JP Morgan | 52 | 296.600 | Bank Central Asia Tbk PT | Citibank | (207) |
| (3.000) | Yihai International Holding Ltd | Citibank | 534 | 187.400 | Bank Central Asia Tbk PT | HSBC | (1.595) |
| (87.000) | Youyuan International Holdings Ltd' | Citibank | 2.450 | 414.300 | Bank Central Asia Tbk PT | JP Morgan | (3.957) |
| (38.000) | Youyuan International Holdings Ltd' | JP Morgan | (189) | 22.000 | Bank Mandiri Persero Tbk PT | HSBC | (258) |
| 12.500 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | Citibank | (2.042) | (40.100) | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | JP Morgan | 793 |
| 14.000 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | HSBC | (3.598) | 61.200 | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | Citibank | 464 |
| 7.000 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | JP Morgan | (1.823) | 81.700 | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | HSBC | 2.040 |
| 176.000 | Yuexiu (REIT) | Citibank | (526) | 57.700 | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | JP Morgan | 1.407 |
| 46.000 | Yuexiu (REIT) | HSBC | (859) | 3.100 | Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT | Citibank | (8) |
| 137.000 | Yuexiu (REIT) | JP Morgan | (2.562) | 14.100 | Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT | HSBC | 39 |
| 8.000 | Yuexiu Transport Infrastructure Ltd | HSBC | (788) | 223.900 | Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT | JP Morgan | 581 |
| 10.000 | Yuexiu Transport Infrastructure Ltd | JP Morgan | (986) | (672.534) | Barito Pacific Tbk PT | JP Morgan | 3.482 |
| 11.200 | Zangge Mining Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (3.333) | | | | |
| 2.500 | Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H' | Citibank | (26) | | | | |
| 2.500 | Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H' | HSBC | (822) | | | | |
| 38.500 | Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H' | JP Morgan | (12.661) | | | | |
| 12.000 | Zhejiang Expressway Co Ltd 'H' | Citibank | (998) | | | | |
| 14.000 | Zhejiang Expressway Co Ltd 'H' | HSBC | (1.337) | | | | |
| 6.000 | Zhejiang Expressway Co Ltd 'H' | JP Morgan | (573) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--|-------------|--|--------------------------|--|-------------|--|
| Indonesien Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (24.400) | Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT | HSBC | (289) | (8) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | HSBC | (281) |
| (289.200) | Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT | JP Morgan | (1.541) | (5) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (382) |
| (71.000) | Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT | JP Morgan | 1.790 | (400) | Advantest Corp | Citibank | (9.527) |
| (82.300) | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT | HSBC | (2.512) | (100) | Aeon Co Ltd | JP Morgan | 62 |
| (181.200) | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT | JP Morgan | (5.299) | 2.000 | Aeon Delight Co Ltd | Citibank | (3.249) |
| (27.100) | Indofood Sukses Makmur Tbk PT | JP Morgan | (140) | 4.200 | Aeon Delight Co Ltd | JP Morgan | (6.723) |
| (25.600) | Indosat Tbk PT | JP Morgan | (655) | 100 | Aeon Fantasy Co Ltd | Citibank | (198) |
| 290.700 | Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT | Citibank | (778) | 9.000 | AEON Financial Service Co Ltd | Citibank | (3.966) |
| 372.000 | Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT | HSBC | (2.380) | 3.400 | AEON Financial Service Co Ltd | HSBC | (1.925) |
| 88.200 | Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT | JP Morgan | (572) | 1.500 | AEON Financial Service Co Ltd | JP Morgan | (708) |
| 11.400 | Jasa Marga Persero Tbk PT | HSBC | (50) | 8.400 | Aeon Hokkaido Corp | Citibank | (1.074) |
| (782.000) | Kalbe Farma Tbk PT | JP Morgan | 6.003 | 11.800 | Aeon Hokkaido Corp | JP Morgan | (2.700) |
| (6.947) | Merdeka Copper Gold Tbk PT | Citibank | (14) | (67) | AEON Investment Corp (REIT) | HSBC | 1.220 |
| (93.300) | Merdeka Copper Gold Tbk PT | HSBC | 2.844 | (1.300) | Aeon Mall Co Ltd | HSBC | 1.516 |
| (127.950) | Merdeka Copper Gold Tbk PT | JP Morgan | 3.950 | (32.200) | Aeon Mall Co Ltd | JP Morgan | 37.509 |
| (24.200) | Metro Healthcare Indonesia Tbk PT | JP Morgan | (6) | (1.200) | AGC Inc | HSBC | 1.530 |
| 243.700 | Mitra Adiperkasa Tbk PT | Citibank | 1.770 | (1.500) | AGC Inc | JP Morgan | 1.906 |
| 66.600 | Mitra Adiperkasa Tbk PT | HSBC | 1.090 | 1.200 | Ai Holdings Corp | Citibank | (1.260) |
| 214.800 | Mitra Adiperkasa Tbk PT | JP Morgan | 3.479 | 2.300 | Aica Kogyo Co Ltd | Citibank | (984) |
| 196.000 | Perusahaan Gas Negara Tbk PT | Citibank | 796 | 1.600 | Aica Kogyo Co Ltd | HSBC | (1.149) |
| 497.800 | Perusahaan Gas Negara Tbk PT | HSBC | 418 | 2.500 | Aica Kogyo Co Ltd | JP Morgan | (2.592) |
| 777.800 | Perusahaan Gas Negara Tbk PT | JP Morgan | 527 | 8.000 | Aichi Corp | Citibank | (2.187) |
| (782.100) | Sarana Menara Nusantara Tbk PT | JP Morgan | 1.908 | 3.500 | Aichi Corp | HSBC | (954) |
| (262.400) | Telkom Indonesia Persero Tbk PT | HSBC | 1.752 | 2.700 | Aichi Corp | JP Morgan | (531) |
| (455.600) | Telkom Indonesia Persero Tbk PT | JP Morgan | 3.257 | (33) | Aichi Financial Group Inc ^{nr} | Citibank | — |
| (100.800) | Unilever Indonesia Tbk PT | HSBC | (200) | (4.195) | Aichi Financial Group Inc | HSBC | 2.365 |
| (11.800) | Unilever Indonesia Tbk PT | JP Morgan | (97) | (5.200) | Aida Engineering Ltd | Citibank | 1.830 |
| | | | 10.111 | (6.300) | Aida Engineering Ltd | HSBC | 1.868 |
| | | | | 200 | Aidma Holdings Inc | Citibank | (318) |
| | | | | 800 | Aidma Holdings Inc | HSBC | (1.765) |
| | | | | 200 | Aidma Holdings Inc | JP Morgan | (567) |
| | | | | (10.700) | Aiful Corp | Citibank | 1.433 |
| | | | | (1.800) | Aiful Corp | HSBC | 699 |
| | | | | (9.700) | Aiful Corp | JP Morgan | 3.766 |
| | | | | 800 | Ain Holdings Inc | Citibank | (2.865) |
| | | | | 100 | Ain Holdings Inc | HSBC | (239) |
| | | | | 400 | Ain Holdings Inc | JP Morgan | (1.081) |
| | | | | 2.500 | Air Water Inc | HSBC | (980) |
| | | | | (1.100) | Airtrip Corp | JP Morgan | 1.271 |
| | | | | (1.000) | Aisin Corp | Citibank | 410 |
| | | | | (2.000) | Aisin Corp | HSBC | 898 |
| | | | | (5.700) | Aisin Corp | JP Morgan | 2.770 |
| | | | | (100) | Ajinomoto Co Inc | Citibank | (32) |
| | | | | (3.900) | Ajinomoto Co Inc | HSBC | (10.282) |
| | | | | (2.200) | Ajinomoto Co Inc | JP Morgan | (1.661) |
| | | | | (1.000) | Alpen Co Ltd | Citibank | 606 |
| | | | | (1.900) | Alpen Co Ltd | HSBC | 2.759 |
| | | | | (2.000) | Alpen Co Ltd | JP Morgan | 2.900 |
| | | | | (1.300) | Alps Alpine Co Ltd | JP Morgan | 245 |
| | | | | 500 | Altech Corp | HSBC | 456 |
| | | | | (3.600) | Amada Co Ltd | JP Morgan | 57 |
| | | | | (700) | Amano Corp | Citibank | 666 |
| | | | | (100) | Amano Corp | HSBC | 37 |
| | | | | (200) | Amano Corp | JP Morgan | 74 |
| | | | | 500 | Amvis Holdings Inc | HSBC | 133 |
| | | | | 3.200 | ANA Holdings Inc | JP Morgan | (1.005) |
| | | | | 8.700 | Anicom Holdings Inc | Citibank | 138 |
| | | | | 2.600 | Anicom Holdings Inc | HSBC | 784 |
| | | | | 5.500 | Anicom Holdings Inc | JP Morgan | 1.661 |
| | | | | 6.300 | Anritsu Corp | Citibank | (1.688) |
| | | | | 2.600 | Anritsu Corp | HSBC | (1.702) |
| | | | | 7.200 | Anritsu Corp | JP Morgan | (4.653) |
| | | | | 500 | Anycolor Inc | Citibank | 712 |
| | | | | 300 | Anycolor Inc | HSBC | 1.421 |
| | | | | | | | |
| | Japan | | | | | | |
| 600 | ABC-Mart Inc | Citibank | (2.376) | | | | |
| 45.600 | Acom Co Ltd | Citibank | (5.698) | | | | |
| 62.300 | Acom Co Ltd | HSBC | (14.554) | | | | |
| 67.100 | Acom Co Ltd | JP Morgan | (14.030) | | | | |
| (2) | Activia Properties Inc (REIT) | HSBC | 241 | | | | |
| (16) | Activia Properties Inc (REIT) | JP Morgan | 1.628 | | | | |
| 3.200 | Adastria Co Ltd | JP Morgan | 2.625 | | | | |
| (500) | ADEKA Corp | Citibank | 227 | | | | |
| (700) | ADEKA Corp | HSBC | (196) | | | | |
| (2.000) | ADEKA Corp | JP Morgan | (563) | | | | |
| (15) | Advance Logistics Investment Corp (REIT) | Citibank | 221 | | | | |
| (10) | Advance Logistics Investment Corp (REIT) | HSBC | 260 | | | | |
| (52) | Advance Logistics Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 1.345 | | | | |
| (20) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | Citibank | (388) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 500 | Anycolor Inc | JP Morgan | 1.687 | 1.100 | Bell System24 Holdings Inc | HSBC | (332) |
| (1.300) | AOKI Holdings Inc | Citibank | 403 | 1.800 | Bell System24 Holdings Inc | JP Morgan | (339) |
| (4.800) | AOKI Holdings Inc | HSBC | 5.584 | (1.500) | Belluna Co Ltd | Citibank | 657 |
| (600) | AOKI Holdings Inc | JP Morgan | 730 | (5.800) | Belluna Co Ltd | HSBC | 2.141 |
| (1.100) | Aoyama Trading Co Ltd | Citibank | (852) | (6.500) | Belluna Co Ltd | JP Morgan | 3.150 |
| (2.400) | Aozora Bank Ltd | JP Morgan | (114) | 8.600 | Benesse Holdings Inc | Citibank | (12.617) |
| 900 | Arata Corp | Citibank | (1.145) | 3.900 | Benesse Holdings Inc | HSBC | (7.848) |
| 300 | Arata Corp | HSBC | 5 | 100 | Bengo4.com Inc | HSBC | 47 |
| 2.100 | Arata Corp | JP Morgan | (92) | 100 | Bengo4.com Inc | JP Morgan | 123 |
| 7.400 | Arcland Service Holdings Co Ltd | Citibank | (2.350) | 600 | Bridgestone Corp | Citibank | (636) |
| (6.600) | ARCLANDS Corp | JP Morgan | 991 | 2.300 | Bridgestone Corp | HSBC | (351) |
| 3.500 | Arcs Co Ltd | Citibank | (6.069) | 4.700 | Bridgestone Corp | JP Morgan | (2.394) |
| (100) | Argo Graphics Inc | Citibank | 135 | (3.900) | Brother Industries Ltd | Citibank | 2.610 |
| (1.400) | Ariake Japan Co Ltd | Citibank | 6.527 | (2.200) | Brother Industries Ltd | HSBC | 943 |
| (1.600) | Ariake Japan Co Ltd | HSBC | 8.009 | (2.500) | Brother Industries Ltd | JP Morgan | 1.188 |
| (800) | Ariake Japan Co Ltd | JP Morgan | 4.076 | 15.500 | Bunka Shutter Co Ltd | Citibank | (8.565) |
| (1.400) | Aruhi Corp | Citibank | 162 | 8.700 | Bunka Shutter Co Ltd | HSBC | (6.017) |
| (1.300) | Aruhi Corp | JP Morgan | 282 | 5.600 | Bunka Shutter Co Ltd | JP Morgan | (3.868) |
| (900) | As One Corp | JP Morgan | 2.841 | (2.000) | Bushiroad Inc | Citibank | 1.893 |
| (1.600) | Asahi Group Holdings Ltd | Citibank | 2.945 | (1.000) | Bushiroad Inc | JP Morgan | 582 |
| (700) | Asahi Group Holdings Ltd | HSBC | 166 | (400) | C Uyemura & Co Ltd | HSBC | (68) |
| (3.700) | Asahi Group Holdings Ltd | JP Morgan | 5.357 | (1.300) | Calbee Inc | Citibank | 1.245 |
| (500) | Asahi Holdings Inc | Citibank | 603 | (400) | Calbee Inc | HSBC | 1.178 |
| (2.700) | Asahi Holdings Inc | HSBC | 2.962 | (900) | Calbee Inc | JP Morgan | 2.385 |
| (300) | Asahi Holdings Inc | JP Morgan | 395 | 4.600 | Canon Inc | Citibank | (1.248) |
| (300) | Asahi Intecc Co Ltd | Citibank | 527 | 2.700 | Canon Inc | HSBC | 1.651 |
| (2.500) | Asahi Intecc Co Ltd | HSBC | (702) | 700 | Canon Inc | JP Morgan | 644 |
| (300) | Asahi Intecc Co Ltd | JP Morgan | (85) | 900 | Canon Marketing Japan Inc | Citibank | (633) |
| 5.500 | Asahi Kasei Corp | Citibank | (1.310) | 1.700 | Canon Marketing Japan Inc | HSBC | (1.191) |
| 5.100 | Asahi Kasei Corp | HSBC | (1.248) | 2.000 | Canon Marketing Japan Inc | JP Morgan | (1.396) |
| 9.100 | Asahi Kasei Corp | JP Morgan | (1.131) | (3.000) | Carenet Inc | Citibank | 642 |
| (700) | ASAHI YUKIZAI Corp | Citibank | (829) | (500) | Carenet Inc | JP Morgan | 414 |
| (500) | ASAHI YUKIZAI Corp | HSBC | (1.169) | 4.600 | Casio Computer Co Ltd | HSBC | (7.085) |
| (100) | ASAHI YUKIZAI Corp | JP Morgan | (230) | 1.700 | Casio Computer Co Ltd | JP Morgan | (2.616) |
| (1.200) | Asanuma Corp | Citibank | 1.234 | 1.400 | Cawachi Ltd | Citibank | (892) |
| (1.500) | Asanuma Corp | HSBC | 1.642 | 3.100 | Cawachi Ltd | JP Morgan | (3.245) |
| (3.200) | Asanuma Corp | JP Morgan | 3.494 | 400 | CellSource Co Ltd | HSBC | (407) |
| 2.400 | Asics Corp | Citibank | (3.081) | 300 | CellSource Co Ltd | JP Morgan | (305) |
| 1.700 | Asics Corp | HSBC | (486) | 600 | Central Glass Co Ltd | Citibank | 144 |
| 900 | Asics Corp | JP Morgan | (2.134) | 1.600 | Central Glass Co Ltd | HSBC | (423) |
| (2.000) | ASKUL Corp | Citibank | 1.523 | 2.300 | Central Glass Co Ltd | JP Morgan | (648) |
| (1.000) | ASKUL Corp | HSBC | 186 | 600 | Central Japan Railway Co | Citibank | (2.728) |
| (600) | ASKUL Corp | JP Morgan | 111 | 900 | Central Japan Railway Co | HSBC | (1.314) |
| 2.500 | Astellas Pharma Inc | Citibank | (2.505) | 1.600 | Central Japan Railway Co | JP Morgan | (8.946) |
| 11.000 | Astellas Pharma Inc | JP Morgan | 3.133 | (2.200) | Change Holdings Inc | Citibank | 1.109 |
| (8.400) | Atom Corp | Citibank | 1.506 | (300) | Charm Care Corp KK | Citibank | (94) |
| (5.400) | Atom Corp | HSBC | 1.849 | (300) | Charm Care Corp KK | JP Morgan | (132) |
| (17.400) | Atom Corp | JP Morgan | 5.946 | 4.300 | Chiba Bank Ltd | Citibank | (794) |
| 1.000 | Autobacs Seven Co Ltd | Citibank | (257) | 4.400 | Chiba Bank Ltd | HSBC | (876) |
| 2.600 | Autobacs Seven Co Ltd | HSBC | (1.253) | 1.900 | Chiba Bank Ltd | JP Morgan | (377) |
| 600 | Autobacs Seven Co Ltd | JP Morgan | (452) | (5.400) | Chiyoda Corp | JP Morgan | 1.375 |
| (2.600) | Avex Inc | Citibank | 2.185 | 2.800 | Chubu Shiryō Co Ltd | Citibank | (1.311) |
| (900) | Avex Inc | HSBC | 703 | 8.400 | Chubu Shiryō Co Ltd | JP Morgan | (3.847) |
| (500) | Avex Inc | JP Morgan | 390 | (6.800) | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 9 |
| 4.000 | Awa Bank Ltd | Citibank | (3.391) | (800) | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 156 |
| 2.100 | Awa Bank Ltd | HSBC | (1.583) | (1.600) | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 125 |
| 900 | Awa Bank Ltd | JP Morgan | (677) | 700 | Chugin Financial Group Inc | HSBC | (371) |
| 500 | AZ-COM MARUWA Holdings Inc | Citibank | (392) | 3.800 | Chugoku Marine Paints Ltd | HSBC | (2.123) |
| 700 | AZ-COM MARUWA Holdings Inc | HSBC | 35 | 8.600 | Chugoku Marine Paints Ltd | JP Morgan | (10.661) |
| (3.400) | Bandai Namco Holdings Inc | HSBC | (1.176) | 21.000 | Citizen Watch Co Ltd | Citibank | 4.540 |
| (200) | Bank of Kyoto Ltd | Citibank | 433 | 6.100 | Citizen Watch Co Ltd | HSBC | 3.018 |
| (1.100) | Bank of Kyoto Ltd | HSBC | 1.945 | 2.900 | Citizen Watch Co Ltd | JP Morgan | 1.315 |
| (400) | Bank of Kyoto Ltd | JP Morgan | 876 | (400) | CKD Corp | Citibank | 108 |
| (600) | Bank of Nagoya Ltd | HSBC | 587 | (800) | CKD Corp | HSBC | (187) |
| 100 | Base Co Ltd | JP Morgan | (561) | (1.800) | CKD Corp | JP Morgan | 249 |
| 100 | BayCurrent Consulting Inc | HSBC | 9 | 5.400 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | Citibank | (3.983) |
| 6.000 | Bell System24 Holdings Inc | Citibank | (1.563) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|--------------------------|---|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 5.300 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | HSBC | 26 | (100) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | HSBC | 148 |
| 4.800 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | JP Morgan | 30 | (3.600) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | JP Morgan | 5.309 |
| (12.500) | COLOPL Inc | Citibank | 2.540 | (400) | Daikin Industries Ltd | Citibank | 5.109 |
| (2.600) | Colowide Co Ltd | Citibank | 2.772 | (400) | Daikin Industries Ltd | HSBC | 3.466 |
| (1.000) | Colowide Co Ltd | JP Morgan | 1.510 | (600) | Daikin Industries Ltd | JP Morgan | (580) |
| 3 | Comforia Residential Inc (REIT) | JP Morgan | (294) | (100) | Daikokutenbussan Co Ltd | JP Morgan | 346 |
| 2.500 | COMSYS Holdings Corp | Citibank | (3.389) | (2.900) | Daio Paper Corp | Citibank | 845 |
| 5.700 | COMSYS Holdings Corp™ | HSBC | — | (9.700) | Daio Paper Corp | HSBC | 9.073 |
| 1.000 | COMSYS Holdings Corp | JP Morgan | 2 | (11.800) | Daio Paper Corp | JP Morgan | 11.085 |
| 20.400 | Concordia Financial Group Ltd | Citibank | (882) | (1.400) | Daiseiki Co Ltd | Citibank | 5.311 |
| 14.000 | Concordia Financial Group Ltd | HSBC | 1.519 | (700) | Daiseiki Co Ltd | HSBC | 3.306 |
| 15.700 | Concordia Financial Group Ltd | JP Morgan | 1.711 | (200) | Daiseiki Co Ltd | JP Morgan | 431 |
| (400) | Cosmos Pharmaceutical Corp | Citibank | 4.005 | (2.200) | Daishinku Corp | Citibank | 827 |
| (200) | Cosmos Pharmaceutical Corp | HSBC | 1.201 | (10.500) | Daishinku Corp | JP Morgan | 5.258 |
| (800) | Cosmos Pharmaceutical Corp | JP Morgan | 6.033 | 700 | Daito Trust Construction Co Ltd | Citibank | (3.605) |
| 3.200 | Cover Corp | Citibank | (1.906) | 500 | Daito Trust Construction Co Ltd | HSBC | (2.152) |
| 2.800 | Cover Corp | JP Morgan | 888 | 100 | Daito Trust Construction Co Ltd | JP Morgan | (406) |
| (89) | CRE Logistics Inc (REIT) | Citibank | 887 | 1.900 | Daiwa House Industry Co Ltd | JP Morgan | 621 |
| (10) | CRE Logistics Inc (REIT) | HSBC | 189 | (10) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | Citibank | 533 |
| (75) | CRE Logistics Inc (REIT) | JP Morgan | 706 | (5) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | HSBC | 394 |
| (9.100) | Create Restaurants Holdings Inc | Citibank | 2.345 | (10) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 789 |
| (3.600) | Create Restaurants Holdings Inc | HSBC | 1.075 | 3 | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | Citibank | (296) |
| 1.300 | Create SD Holdings Co Ltd | Citibank | (2.789) | 7 | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | HSBC | (1.810) |
| 200 | Create SD Holdings Co Ltd | HSBC | (143) | 11 | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (2.838) |
| 2.900 | Create SD Holdings Co Ltd | JP Morgan | (2.071) | (24.600) | Daiwa Securities Group Inc | JP Morgan | 3.976 |
| (2.600) | Credit Saison Co Ltd | Citibank | 845 | (21) | Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT) | Citibank | (339) |
| (600) | Credit Saison Co Ltd | JP Morgan | 129 | (86) | Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT) | HSBC | 887 |
| 2.400 | Creek & River Co Ltd | Citibank | (3.375) | (10.300) | DCM Holdings Co Ltd | Citibank | 7.232 |
| 900 | Creek & River Co Ltd | HSBC | (1.615) | (4.300) | DCM Holdings Co Ltd | HSBC | 5.077 |
| 1.900 | Creek & River Co Ltd | JP Morgan | (3.383) | (3.300) | DCM Holdings Co Ltd | JP Morgan | 3.892 |
| 500 | Curves Holdings Co Ltd | Citibank | (244) | (3.000) | DeNA Co Ltd | Citibank | 3.768 |
| 1.100 | Curves Holdings Co Ltd | HSBC | (176) | (3.700) | DeNA Co Ltd | HSBC | 3.909 |
| 11.900 | CyberAgent Inc | Citibank | (3.246) | (19.200) | DeNA Co Ltd | JP Morgan | 28.760 |
| 2.400 | CyberAgent Inc | HSBC | (1.193) | 1.400 | Denka Co Ltd | Citibank | (1.709) |
| 2.200 | CyberAgent Inc | JP Morgan | (2.987) | 3.100 | Denka Co Ltd | HSBC | (4.342) |
| (10.600) | CYBERDYNE Inc | Citibank | (1.622) | 10.200 | Denka Co Ltd | JP Morgan | (15.458) |
| (1.500) | CYBERDYNE Inc | HSBC | (87) | (1.000) | Denso Corp | HSBC | 374 |
| (35.400) | CYBERDYNE Inc | JP Morgan | (2.083) | (2.800) | Denso Corp | JP Morgan | (2.653) |
| (1.700) | Dai Nippon Printing Co Ltd | JP Morgan | 1.001 | (400) | Dentsu Group Inc | HSBC | 1.569 |
| 500 | Daido Steel Co Ltd | HSBC | (565) | (2.800) | Dentsu Group Inc | JP Morgan | 10.969 |
| 100 | Daido Steel Co Ltd | JP Morgan | (177) | (600) | Descente Ltd | Citibank | 1.910 |
| (200) | Daiei Kankyo Co Ltd | Citibank | 46 | (100) | Descente Ltd | HSBC | 530 |
| (3.500) | Daiei Kankyo Co Ltd | JP Morgan | (1.072) | (900) | Descente Ltd | JP Morgan | 4.767 |
| (1.000) | Daifuku Co Ltd | Citibank | 73 | (1.700) | Dexerials Corp | Citibank | (2.505) |
| (1.000) | Daifuku Co Ltd | JP Morgan | 111 | (1.000) | Dexerials Corp | HSBC | (2.643) |
| (1.300) | Daiho Corp | Citibank | 1.434 | (600) | Dexerials Corp | JP Morgan | (1.693) |
| (700) | Daiho Corp | HSBC | 1.859 | (1.800) | DIC Corp | Citibank | 1.401 |
| (500) | Daiho Corp | JP Morgan | 1.329 | (3.300) | DIC Corp | HSBC | 2.857 |
| 500 | Dai-ichi Life Holdings Inc | Citibank | (637) | (5.800) | DIC Corp | JP Morgan | 3.231 |
| 600 | Dai-ichi Life Holdings Inc | HSBC | (924) | 1.700 | Digital Arts Inc | Citibank | 2.419 |
| 2.700 | Dai-ichi Life Holdings Inc | JP Morgan | (3.800) | 900 | Digital Arts Inc | HSBC | 1.178 |
| 1.400 | Daichi Sankyo Co Ltd | Citibank | (4.167) | 900 | Digital Arts Inc | JP Morgan | 276 |
| 1.000 | Daichi Sankyo Co Ltd | JP Morgan | (1.478) | (1.600) | Digital Garage Inc | JP Morgan | 12.324 |
| (3.900) | Daichikoshu Co Ltd | Citibank | 2.648 | 2.200 | Direct Marketing MiX Inc | Citibank | (4.529) |
| (2.700) | Daichikoshu Co Ltd | HSBC | 2.919 | 1.400 | Direct Marketing MiX Inc | HSBC | (3.277) |
| (4.500) | Daichikoshu Co Ltd | JP Morgan | 5.217 | 1.100 | Direct Marketing MiX Inc | JP Morgan | (2.227) |
| 1.500 | Daiken Corp | Citibank | (1.383) | | | | |
| (2.500) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | Citibank | 1.399 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------|---|--------------------------|------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 3.400 | DMG Mori Co Ltd | Citibank | 77 | (6) | Frontier Real Estate | | |
| 2.200 | DMG Mori Co Ltd | HSBC | 1.071 | | Investment Corp (REIT) | HSBC | 516 |
| 1.000 | DMG Mori Co Ltd | JP Morgan | 159 | (15) | Frontier Real Estate | | |
| 2.100 | Doshisha Co Ltd | Citibank | (1.829) | | Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 1.283 |
| 2.300 | Doshisha Co Ltd | JP Morgan | (1.577) | (400) | Fudo Tetra Corp | HSBC | 328 |
| 3.400 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | Citibank | (2.776) | (2.100) | Fudo Tetra Corp | JP Morgan | 1.719 |
| 1.000 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | HSBC | (1.232) | (2.100) | Fuji Co Ltd | Citibank | 1.326 |
| 900 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.107) | (400) | Fuji Co Ltd | JP Morgan | 260 |
| 200 | Dowa Holdings Co Ltd | Citibank | (576) | 2.000 | Fuji Electric Co Ltd | Citibank | (5.766) |
| 400 | Dowa Holdings Co Ltd | HSBC | (1.698) | 2.000 | Fuji Electric Co Ltd | HSBC | 213 |
| 400 | DTS Corp | Citibank | (53) | 700 | Fuji Electric Co Ltd | JP Morgan | 1.086 |
| 100 | DTS Corp | HSBC | 24 | (800) | Fuji Kyuko Co Ltd | Citibank | 2.298 |
| 2.700 | DTS Corp | JP Morgan | 2.453 | (1.000) | Fuji Kyuko Co Ltd | HSBC | 1.745 |
| (300) | Duskin Co Ltd | HSBC | 859 | (900) | Fuji Kyuko Co Ltd | JP Morgan | 1.566 |
| (100) | DyDo Group Holdings Inc | HSBC | 147 | 1.500 | Fuji Media Holdings Inc | HSBC | (176) |
| (3.600) | East Japan Railway Co | JP Morgan | 13.292 | 400 | Fuji Media Holdings Inc | JP Morgan | (119) |
| (400) | Ebara Corp | Citibank | 272 | (500) | Fuji Oil Holdings Inc | Citibank | 466 |
| (2.200) | Ebara Corp | HSBC | (560) | 3.200 | Fuji Seal International Inc | Citibank | (3.355) |
| (600) | Ebara Corp | JP Morgan | (156) | 2.200 | Fuji Seal International Inc | HSBC | (1.607) |
| (1.900) | EDION Corp | HSBC | 723 | 7.700 | Fuji Seal International Inc | JP Morgan | (6.334) |
| (800) | EDION Corp | JP Morgan | 295 | (1.100) | Fuji Soft Inc | JP Morgan | (1.486) |
| 1.600 | eGuarantee Inc | Citibank | (877) | 3.000 | Fujicco Co Ltd | Citibank | (1.828) |
| 1.300 | eGuarantee Inc | HSBC | (1.362) | 1.400 | Fujicco Co Ltd | JP Morgan | (1.341) |
| 1.700 | eGuarantee Inc | JP Morgan | (1.524) | 300 | FUJIFILM Holdings Corp | Citibank | 268 |
| 400 | Eisai Co Ltd | JP Morgan | 1.123 | 800 | FUJIFILM Holdings Corp | HSBC | 5.998 |
| (1.000) | Eizo Corp | Citibank | 1.227 | 1.400 | Fujikura Ltd | Citibank | 664 |
| (1.200) | Eizo Corp | HSBC | (1.380) | 2.800 | Fujikura Ltd | HSBC | 2.943 |
| (1.000) | Eizo Corp | JP Morgan | (1.148) | 2.300 | Fujikura Ltd | JP Morgan | 2.419 |
| 700 | Elan Corp | Citibank | (489) | (300) | Fujimi Inc | HSBC | (1.405) |
| 400 | Elan Corp | HSBC | (212) | (800) | Fujimi Inc | JP Morgan | (8.438) |
| 3.400 | Elecom Co Ltd | Citibank | 1.819 | 3.000 | Fujimori Kogyo Co Ltd | Citibank | (125) |
| 2.400 | Elecom Co Ltd | HSBC | 2.062 | 1.200 | Fujimori Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 605 |
| 500 | Elecom Co Ltd | JP Morgan | 430 | (8.600) | Fujio Food Group Inc | Citibank | 1.422 |
| (1.100) | en Japan Inc | Citibank | 1.665 | (11.400) | Fujio Food Group Inc | JP Morgan | 1.004 |
| (1.300) | en Japan Inc | HSBC | 1.598 | (400) | Fujitec Co Ltd | Citibank | 782 |
| (1.400) | en Japan Inc | JP Morgan | 2.141 | (2.500) | Fujitec Co Ltd | JP Morgan | 5.089 |
| (13.600) | ENEOS Holdings Inc | HSBC | 3.377 | 1.400 | Fujitsu General Ltd | Citibank | (1.651) |
| (9.000) | ENEOS Holdings Inc | JP Morgan | 2.231 | 1.000 | Fujitsu General Ltd | HSBC | (2.250) |
| (100) | ES-Con Japan Ltd | Citibank | (3) | 2.900 | Fujitsu General Ltd | JP Morgan | (2.346) |
| (10.400) | ES-Con Japan Ltd | HSBC | 9.415 | 200 | Fujitsu Ltd | HSBC | (1.413) |
| (9.900) | ES-Con Japan Ltd | JP Morgan | 8.975 | 900 | Fujitsu Ltd | JP Morgan | (6.347) |
| (10.900) | euglena Co Ltd | Citibank | (282) | (300) | Fujiya Co Ltd | Citibank | 198 |
| (4.400) | euglena Co Ltd | HSBC | 979 | 800 | Fukui Computer Holdings Inc | Citibank | (1.195) |
| (1.900) | euglena Co Ltd | JP Morgan | 327 | 300 | Fukui Computer Holdings Inc | HSBC | (363) |
| (2.800) | ExaWizards Inc | JP Morgan | (2.589) | 400 | Fukui Computer Holdings Inc | JP Morgan | (156) |
| 1.100 | Ezaki Glico Co Ltd | Citibank | (1.165) | 500 | Fukuoka Financial Group Inc | Citibank | (312) |
| 4.500 | Ezaki Glico Co Ltd | JP Morgan | 555 | 2.700 | Fukuoka Financial Group Inc | HSBC | (300) |
| 1.000 | Fancl Corp | HSBC | (675) | 4.400 | Fukuoka Financial Group Inc | JP Morgan | (45) |
| 1.300 | Fancl Corp | JP Morgan | (918) | (300) | Fukushima Galilei Co Ltd | Citibank | 428 |
| 5.800 | FANUC Corp | Citibank | (2.423) | (1.400) | Fukushima Galilei Co Ltd | HSBC | 594 |
| 200 | FANUC Corp | HSBC | 89 | (700) | Fukushima Galilei Co Ltd | JP Morgan | 1.841 |
| 2.700 | FANUC Corp | JP Morgan | 693 | (1.000) | Fukuyama Transporting Co Ltd | Citibank | 2.653 |
| 600 | Fast Fitness Japan Inc | Citibank | (585) | (300) | Fukuyama Transporting Co Ltd | HSBC | 791 |
| 200 | Fast Fitness Japan Inc | HSBC | (763) | (400) | Fukuyama Transporting Co Ltd | JP Morgan | 568 |
| 600 | Fast Fitness Japan Inc | JP Morgan | (2.287) | 2.900 | FULLCAST Holdings Co Ltd | Citibank | (5.783) |
| 26.400 | FCC Co Ltd | Citibank | (20.094) | 3.100 | FULLCAST Holdings Co Ltd | JP Morgan | (6.310) |
| 2.000 | FCC Co Ltd | JP Morgan | (914) | 9.800 | Funai Soken Holdings Inc | Citibank | (4.761) |
| (2.600) | Ferrotec Holdings Corp | Citibank | (1.330) | 7.200 | Funai Soken Holdings Inc | JP Morgan | (4.237) |
| (3.000) | Ferrotec Holdings Corp | JP Morgan | (3.303) | (100) | Furukawa Battery Co Ltd | HSBC | 90 |
| (1.000) | Food & Life Cos Ltd | Citibank | 1.483 | (400) | Furukawa Battery Co Ltd | JP Morgan | 360 |
| (300) | Food & Life Cos Ltd | HSBC | 375 | (500) | Furukawa Electric Co Ltd | HSBC | 867 |
| (1.400) | Food & Life Cos Ltd | JP Morgan | 1.747 | | | | |
| 300 | FP Corp | JP Morgan | (733) | | | | |
| 100 | FP Partner Inc | JP Morgan | 639 | | | | |
| (1.000) | Freee KK | JP Morgan | 3.068 | | | | |
| (4) | Frontier Real Estate Investment Corp (REIT) | Citibank | 34 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.700) | Furukawa Electric Co Ltd | JP Morgan | 2.943 | (1.300) | Haseko Corp | Citibank | 819 |
| (200) | Furuya Metal Co Ltd | Citibank | (115) | (11.000) | Haseko Corp | HSBC | 8.805 |
| (200) | Furuya Metal Co Ltd | HSBC | 22 | (3.600) | Haseko Corp | JP Morgan | 2.426 |
| (900) | Furuya Metal Co Ltd | JP Morgan | 91 | (3.000) | Heiwa Corp | Citibank | 6.695 |
| 900 | Future Corp | Citibank | (375) | (300) | Heiwa Corp | HSBC | 989 |
| 2.900 | Future Corp | HSBC | (206) | (2.700) | Heiwa Corp | JP Morgan | 8.898 |
| (1.400) | Fuyo General Lease Co Ltd | Citibank | 5.417 | 100 | Heiwa Real Estate Co Ltd | Citibank | (294) |
| (300) | Fuyo General Lease Co Ltd | JP Morgan | 579 | 500 | Heiwa Real Estate Co Ltd | JP Morgan | (1.328) |
| 500 | Geo Holdings Corp | Citibank | (560) | (24) | Heiwa Real Estate Inc (REIT) | HSBC | 2.332 |
| 400 | Geo Holdings Corp | HSBC | (474) | (60) | Heiwa Real Estate Inc (REIT) | JP Morgan | 5.614 |
| (1.700) | giftee Inc | Citibank | 4.431 | 1.400 | Heiwado Co Ltd | HSBC | (883) |
| (1.000) | giftee Inc | JP Morgan | 3.546 | 1.500 | Heiwado Co Ltd | JP Morgan | (943) |
| 2.700 | Giken Ltd | Citibank | (3.223) | 2.200 | Hiday Hidaka Corp | Citibank | (1.142) |
| 1.100 | Giken Ltd | HSBC | (2.244) | 400 | Hiday Hidaka Corp | HSBC | (324) |
| 1.100 | Giken Ltd | JP Morgan | (2.275) | 1.200 | Hiday Hidaka Corp | JP Morgan | (970) |
| 200 | Glory Ltd | Citibank | (390) | 2.600 | Hino Motors Ltd | Citibank | 617 |
| 200 | Glory Ltd | HSBC | (74) | 100 | Hioki EE Corp | Citibank | (515) |
| 1.900 | Glory Ltd | JP Morgan | (3.965) | 300 | Hioki EE Corp | HSBC | (971) |
| (13) | GLP J-Reit (REIT) | Citibank | 344 | (1.800) | Hirata Corp | JP Morgan | 1.510 |
| (92) | GLP J-Reit (REIT) | HSBC | 8.439 | (3.000) | Hirogin Holdings Inc | HSBC | (1.387) |
| (144) | GLP J-Reit (REIT) | JP Morgan | 13.035 | (16.500) | Hirogin Holdings Inc | JP Morgan | (5.682) |
| (3.900) | GMO Financial Holdings Inc | Citibank | (68) | (600) | Hirose Electric Co Ltd | Citibank | 3.194 |
| (4.300) | GMO Financial Holdings Inc | HSBC | 735 | (300) | Hirose Electric Co Ltd | HSBC | 541 |
| (4.700) | GMO Financial Holdings Inc | JP Morgan | 801 | (2.000) | HIS Co Ltd | JP Morgan | 2.504 |
| 4.100 | GMO internet group Inc | Citibank | (5.546) | 4.800 | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | Citibank | (1.296) |
| 4.100 | GMO internet group Inc | HSBC | (6.611) | 700 | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | HSBC | (78) |
| 5.100 | GMO internet group Inc | JP Morgan | (8.212) | 3.700 | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | JP Morgan | 813 |
| 400 | GMO Payment Gateway Inc | Citibank | (1.352) | 9.200 | Hitachi Zosen Corp | Citibank | (2.288) |
| 500 | GMO Payment Gateway Inc | HSBC | (789) | 9.400 | Hitachi Zosen Corp | HSBC | (3.319) |
| 700 | GMO Payment Gateway Inc | JP Morgan | (1.697) | 3.700 | Hitachi Zosen Corp | JP Morgan | (1.443) |
| 5.400 | GNI Group Ltd | Citibank | (1.295) | 700 | Hodogaya Chemical Co Ltd | Citibank | (795) |
| 900 | GNI Group Ltd | HSBC | (33) | 300 | Hodogaya Chemical Co Ltd | JP Morgan | (471) |
| 1.600 | GNI Group Ltd | JP Morgan | 191 | (16.900) | Hokkaido Electric Power Co Inc | Citibank | (2.392) |
| 300 | Goldcrest Co Ltd | Citibank | (142) | (3.200) | Hokkaido Electric Power Co Inc | HSBC | (533) |
| 1.600 | Goldcrest Co Ltd | HSBC | (132) | (14.800) | Hokkaido Electric Power Co Inc | JP Morgan | (3.455) |
| 100 | Goldwin Inc | Citibank | (1.019) | (9.300) | Hokuetsu Corp | Citibank | 5.098 |
| 100 | Goldwin Inc | HSBC | (188) | (1.800) | Hokuetsu Corp | HSBC | 922 |
| 2.000 | Gree Inc | Citibank | (349) | (19.400) | Hokuetsu Corp | JP Morgan | 9.925 |
| 5.000 | Gree Inc | HSBC | (1.762) | (2.000) | Hokuhoku Financial Group Inc | Citibank | 273 |
| 5.000 | Gree Inc | JP Morgan | (826) | (6.200) | Hokuhoku Financial Group Inc | HSBC | (3.289) |
| (1.300) | gremz Inc | JP Morgan | (4.207) | (1.100) | Hokuhoku Financial Group Inc | JP Morgan | (584) |
| (5.000) | GS Yuasa Corp | HSBC | 3.857 | (5.400) | Hokuriku Electric Power Co | Citibank | (1.923) |
| 1.200 | G-Tekt Corp | Citibank | (763) | (4.100) | Hokuriku Electric Power Co | HSBC | (2.259) |
| 3.000 | G-Tekt Corp | HSBC | (2.261) | (3.500) | Hokuriku Electric Power Co | JP Morgan | (1.495) |
| 600 | G-Tekt Corp | JP Morgan | (392) | (6.500) | Hokuto Corp | Citibank | 2.515 |
| (2.700) | GungHo Online Entertainment Inc | HSBC | 3.486 | (3.900) | Hokuto Corp | HSBC | 2.355 |
| (2.300) | GungHo Online Entertainment Inc | JP Morgan | 316 | (7.200) | Hokuto Corp | JP Morgan | 5.183 |
| 4.800 | Gunma Bank Ltd | JP Morgan | 1.005 | (100) | Honda Motor Co Ltd | HSBC | (180) |
| (100) | Gunze Ltd | HSBC | 366 | (6.500) | Honda Motor Co Ltd | JP Morgan | (11.729) |
| (200) | H.U. Group Holdings Inc | Citibank | 69 | 700 | Horiba Ltd | Citibank | (1.254) |
| (2.300) | H.U. Group Holdings Inc | HSBC | 3.520 | 300 | Horiba Ltd | HSBC | (686) |
| (1.700) | H.U. Group Holdings Inc | JP Morgan | 3.200 | 1.500 | Horiba Ltd | JP Morgan | (3.421) |
| 11.700 | Hachijuni Bank Ltd | HSBC | (619) | (2) | Hoshino Resorts Inc (REIT) | Citibank | 455 |
| (4.100) | Hakuhodo DY Holdings Inc | HSBC | 5.384 | (9) | Hoshino Resorts Inc (REIT) | JP Morgan | 4.387 |
| (1.000) | Hakuto Co Ltd | HSBC | (193) | 400 | Hoshizaki Corp | Citibank | (1.170) |
| (1.200) | Hakuto Co Ltd | JP Morgan | (236) | 300 | Hoshizaki Corp | HSBC | (147) |
| 1.000 | Halows Co Ltd | Citibank | (1.004) | 2.000 | Hoshizaki Corp | JP Morgan | (797) |
| 400 | Halows Co Ltd | JP Morgan | (322) | (400) | Hosiden Corp | Citibank | 123 |
| (100) | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Citibank | 159 | (1.400) | Hosiden Corp | HSBC | 892 |
| (5.800) | Hankyu Hanshin Holdings Inc | HSBC | 2.833 | | | | |
| (11.100) | Hankyu Hanshin Holdings Inc | JP Morgan | 5.644 | | | | |
| (1.600) | Hanwa Co Ltd | Citibank | 3.871 | | | | |
| (100) | Hanwa Co Ltd | JP Morgan | 171 | | | | |
| (200) | Harmonic Drive Systems Inc | HSBC | 155 | | | | |
| (400) | Harmonic Drive Systems Inc | JP Morgan | (1.697) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------|---|--------------------------|---|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.800) | Hosiden Corp | JP Morgan | 2.032 | (21) | Invincible Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (76) |
| 3.400 | House Foods Group Inc | Citibank | (1.091) | 2.900 | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | Citibank | (2.112) |
| (100) | Hoya Corp | Citibank | (743) | 1.800 | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | HSBC | (1.526) |
| (100) | Hoya Corp | HSBC | (367) | 6.800 | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | JP Morgan | (657) |
| (10.200) | HS Holdings Co Ltd | Citibank | 3.124 | (4.500) | Ishihara Sangyo Kaisha Ltd | Citibank | 1.549 |
| (4.100) | HS Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.759 | (5.900) | Ishihara Sangyo Kaisha Ltd | HSBC | 1.655 |
| (600) | Ibiden Co Ltd | Citibank | (4.412) | (1.800) | Ishihara Sangyo Kaisha Ltd | JP Morgan | 445 |
| (2.800) | Ibiden Co Ltd | HSBC | (30.364) | 6.000 | Isuzu Motors Ltd | HSBC | (1.745) |
| (1.400) | Ibiden Co Ltd | JP Morgan | (15.189) | 10.400 | Isuzu Motors Ltd | JP Morgan | (3.011) |
| 200 | Ichibanya Co Ltd | Citibank | (258) | 500 | ITmedia Inc | Citibank | (191) |
| 200 | Ichibanya Co Ltd | HSBC | (341) | 600 | ITmedia Inc | HSBC | (506) |
| 6.200 | Ichibanya Co Ltd | JP Morgan | (9.865) | 4.500 | Ito En Ltd | Citibank | (5.991) |
| 7.700 | Ichigo Inc | HSBC | (1.041) | 2.000 | Ito En Ltd | HSBC | (1.379) |
| 74.400 | Ichigo Inc | JP Morgan | (10.044) | 2.900 | Ito En Ltd | JP Morgan | (2.890) |
| (76) | Ichigo Office Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 625 | 1.500 | ITOCHU Corp | Citibank | (793) |
| (1.500) | Idec Corp | Citibank | 3.003 | 3.500 | Itochu Techno-Solutions Corp | Citibank | (513) |
| (500) | Idec Corp | HSBC | 898 | 2.600 | Itochu Techno-Solutions Corp | JP Morgan | (1) |
| (2.500) | Idec Corp | JP Morgan | 4.238 | 900 | Itochu-Shokuhin Co Ltd | Citibank | (1.921) |
| 1.800 | Idemitsu Kosan Co Ltd | Citibank | (1.905) | 500 | Itochu-Shokuhin Co Ltd | HSBC | (1.702) |
| 800 | Idemitsu Kosan Co Ltd | HSBC | (1.679) | 500 | Itochu-Shokuhin Co Ltd | JP Morgan | (1.968) |
| 5.100 | Idemitsu Kosan Co Ltd | JP Morgan | (10.693) | 15.600 | Itoham Yonekyu Holdings Inc | Citibank | (5.613) |
| 6.500 | IDOM Inc | Citibank | (3.097) | 3.100 | Itoham Yonekyu Holdings Inc | HSBC | (1.916) |
| 2.300 | IDOM Inc | JP Morgan | (1.193) | 38.800 | Itoham Yonekyu Holdings Inc | JP Morgan | (14.171) |
| 1.000 | IHI Corp | Citibank | (1.803) | (400) | Iwatani Corp | Citibank | 898 |
| 3.000 | IHI Corp | HSBC | (8.710) | (2.100) | Iwatani Corp | JP Morgan | 1.995 |
| 100 | IHI Corp | JP Morgan | (290) | (900) | Izumi Co Ltd | Citibank | 1.097 |
| (700) | Iida Group Holdings Co Ltd | Citibank | 1.226 | (500) | Izumi Co Ltd | HSBC | 188 |
| (6.700) | Iida Group Holdings Co Ltd | HSBC | 11.492 | (500) | Izumi Co Ltd | JP Morgan | 186 |
| (9.700) | Iida Group Holdings Co Ltd | JP Morgan | 12.701 | 6.500 | J Front Retailing Co Ltd | Citibank | (3.633) |
| (800) | Iino Kaiun Kaisha Ltd | Citibank | 164 | 7.300 | J Front Retailing Co Ltd | HSBC | (5.637) |
| (2.600) | Iino Kaiun Kaisha Ltd | HSBC | 3.213 | 13.200 | JAC Recruitment Co Ltd | Citibank | (18.845) |
| (2.500) | Iino Kaiun Kaisha Ltd | JP Morgan | 483 | 400 | JAC Recruitment Co Ltd | JP Morgan | (1.063) |
| 800 | I'll Inc | Citibank | (1.229) | (1.300) | Jaccs Co Ltd | Citibank | 2.498 |
| 1.700 | I'll Inc | JP Morgan | (2.663) | (1.000) | Jaccs Co Ltd | HSBC | 1.485 |
| 3.300 | Inaba Denki Sangyo Co Ltd | HSBC | (3.986) | (3.500) | Jaccs Co Ltd | JP Morgan | 5.057 |
| (6.500) | Inabata & Co Ltd | Citibank | 9.094 | 300 | JAFCO Group Co Ltd | Citibank | (138) |
| (1.900) | Inabata & Co Ltd | HSBC | 208 | 800 | JAFCO Group Co Ltd | HSBC | (282) |
| (1.500) | Inabata & Co Ltd | JP Morgan | 161 | 3.900 | JAFCO Group Co Ltd | JP Morgan | (1.696) |
| (700) | Inageya Co Ltd | Citibank | 126 | (1.900) | Japan Airlines Co Ltd | Citibank | 2.016 |
| (900) | Inageya Co Ltd | HSBC | 813 | 200 | Japan Airport Terminal Co Ltd | Citibank | (897) |
| (20) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | Citibank | (253) | 500 | Japan Airport Terminal Co Ltd | HSBC | (1.948) |
| (64) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | HSBC | 1.109 | 700 | Japan Airport Terminal Co Ltd | JP Morgan | (2.723) |
| (46) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 791 | (2.900) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | Citibank | 1.771 |
| (3.700) | Infocom Corp | Citibank | 3.339 | (5.300) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | HSBC | 3.336 |
| (100) | Infocom Corp | HSBC | 78 | (2.400) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | JP Morgan | 583 |
| (1.300) | Infocom Corp | JP Morgan | 1.030 | (27.100) | Japan Communications Inc | HSBC | 1.916 |
| 11.300 | Infomart Corp | Citibank | (3.227) | (12.200) | Japan Communications Inc | JP Morgan | 740 |
| 10.000 | Infomart Corp | HSBC | (2.917) | 16.100 | Japan Display Inc | HSBC | (410) |
| 1.900 | Information Services International-Dentsu Ltd | Citibank | (4.461) | 5.800 | Japan Display Inc | JP Morgan | (147) |
| 1.000 | Information Services International-Dentsu Ltd | HSBC | 185 | 200 | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | Citibank | (221) |
| 9.900 | INFRONEER Holdings Inc | Citibank | (4.058) | 800 | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | HSBC | (912) |
| 3.600 | INFRONEER Holdings Inc | HSBC | 1.826 | 800 | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | JP Morgan | (828) |
| 7.600 | INFRONEER Holdings Inc | JP Morgan | 3.861 | | | | |
| 1.700 | Insource Co Ltd | Citibank | (1.433) | | | | |
| 300 | Insource Co Ltd | JP Morgan | (115) | | | | |
| 800 | Internet Initiative Japan Inc | Citibank | (239) | | | | |
| 1.700 | Internet Initiative Japan Inc | JP Morgan | (105) | | | | |
| (1.700) | Inui Global Logistics Co Ltd | HSBC | 5.208 | | | | |
| (13.200) | Inui Global Logistics Co Ltd | JP Morgan | 40.420 | | | | |
| (53) | Invincible Investment Corp (REIT) | HSBC | (258) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|-------------|---|--------------------------|------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.700) | Japan Exchange Group Inc | HSBC | (6) | (1.400) | Justsystems Corp | Citibank | 1.270 |
| (21) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | JP Morgan | (186) | (2.200) | Justsystems Corp | HSBC | (3.209) |
| 8.300 | Japan Lifeline Co Ltd | Citibank | (3.547) | (400) | Justsystems Corp | JP Morgan | (641) |
| 200 | Japan Lifeline Co Ltd | JP Morgan | (69) | 7.200 | JVCKenwood Corp | Citibank | (1.164) |
| (6) | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | HSBC | 325 | (1.400) | Kadokawa Corp | Citibank | 1.896 |
| (5) | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | JP Morgan | 270 | (3.500) | Kadokawa Corp | HSBC | (415) |
| (900) | Japan Material Co Ltd | HSBC | 480 | (4.500) | Kadokawa Corp | JP Morgan | (3.565) |
| 4.200 | Japan Post Bank Co Ltd | HSBC | (331) | 900 | Kaga Electronics Co Ltd | Citibank | (1.403) |
| (12.500) | Japan Post Holdings Co Ltd | HSBC | 8.857 | 500 | Kaga Electronics Co Ltd | JP Morgan | (269) |
| (12.700) | Japan Post Holdings Co Ltd | JP Morgan | 4.347 | (500) | Kagome Co Ltd | HSBC | 1.051 |
| (1.200) | Japan Post Insurance Co Ltd | Citibank | 1.339 | (9.800) | Kagome Co Ltd | JP Morgan | 20.570 |
| (3.600) | Japan Post Insurance Co Ltd | HSBC | 3.635 | (3.000) | Kajima Corp | Citibank | 4.493 |
| (3.200) | Japan Post Insurance Co Ltd | JP Morgan | 3.468 | 800 | Kakaku.com Inc | Citibank | (578) |
| (12) | Japan Real Estate Investment Corp (REIT) | Citibank | 1.288 | 3.400 | Kakaku.com Inc | HSBC | 2.359 |
| (13) | Japan Real Estate Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 2.094 | (1.500) | Kaken Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 2.971 |
| (3.900) | Japan Securities Finance Co Ltd | Citibank | (96) | (300) | Kaken Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 685 |
| (4.900) | Japan Securities Finance Co Ltd | HSBC | (2.206) | (100) | Kaken Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 327 |
| (10.800) | Japan Securities Finance Co Ltd | JP Morgan | (4.872) | (1.500) | Kameda Seika Co Ltd | Citibank | 2.808 |
| (300) | Japan Steel Works Ltd | Citibank | (151) | (400) | Kameda Seika Co Ltd | HSBC | 1.567 |
| (2.300) | Japan Steel Works Ltd | HSBC | (1.296) | (200) | Kameda Seika Co Ltd | JP Morgan | 822 |
| (900) | Japan Steel Works Ltd | JP Morgan | (1.936) | 2.400 | Kamigumi Co Ltd | JP Morgan | (387) |
| 3.800 | Japan Wool Textile Co Ltd | Citibank | (1.670) | 11.800 | Kandenko Co Ltd | Citibank | (7.766) |
| 1.200 | Japan Wool Textile Co Ltd | HSBC | (719) | (1.500) | Kaneka Corp | Citibank | 2.797 |
| 1.300 | Japan Wool Textile Co Ltd | JP Morgan | (777) | (700) | Kaneka Corp | HSBC | 1.295 |
| 800 | JBCC Holdings Inc | HSBC | (524) | (1.100) | Kaneka Corp | JP Morgan | 1.320 |
| (800) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | Citibank | 361 | 16.100 | Kanematsu Corp | Citibank | (8.309) |
| (1.600) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | JP Morgan | 1.097 | 2.700 | Kanematsu Corp | HSBC | (711) |
| 4.400 | JCU Corp | Citibank | (720) | 1.000 | Kansai Paint Co Ltd | Citibank | (890) |
| 500 | JCU Corp | HSBC | 219 | 2.300 | Kansai Paint Co Ltd | HSBC | (140) |
| 2.000 | JCU Corp | JP Morgan | 883 | 3.200 | Kansai Paint Co Ltd | JP Morgan | (1.641) |
| (5.800) | JDC Corp | Citibank | 2.714 | 1.600 | Kao Corp | Citibank | (5.652) |
| (2.400) | JDC Corp | HSBC | 1.292 | (500) | Kappa Create Co Ltd | HSBC | 159 |
| (5.100) | JDC Corp | JP Morgan | 2.051 | (300) | Kappa Create Co Ltd | JP Morgan | 143 |
| (300) | Jeol Ltd | Citibank | (1.196) | 500 | Katakura Industries Co Ltd | JP Morgan | (811) |
| (600) | Jeol Ltd | JP Morgan | (2.415) | 1.900 | Katitas Co Ltd | Citibank | (3.950) |
| 1.900 | JFE Holdings Inc | Citibank | (1.400) | 1.700 | Katitas Co Ltd | HSBC | (2.486) |
| 3.900 | JFE Holdings Inc | JP Morgan | 757 | 2.400 | Katitas Co Ltd | JP Morgan | (2.032) |
| 2.800 | JGC Holdings Corp | Citibank | (65) | 2.500 | Kato Sangyo Co Ltd | Citibank | (2.877) |
| 300 | JGC Holdings Corp | HSBC | 15 | 2.500 | Kato Sangyo Co Ltd | HSBC | (1.475) |
| 2.500 | JGC Holdings Corp | JP Morgan | (838) | 3.700 | Kato Sangyo Co Ltd | JP Morgan | (2.172) |
| 100 | JIG-SAW Inc | Citibank | 94 | (1.200) | Kawasaki Heavy Industries Ltd | Citibank | 1.497 |
| 100 | JIG-SAW Inc | JP Morgan | 48 | (700) | Kawasaki Heavy Industries Ltd | JP Morgan | 763 |
| 2.200 | JINS Holdings Inc | JP Morgan | (2.598) | (900) | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd | Citibank | 1.776 |
| (300) | JMDC Inc | HSBC | (1.567) | 2.600 | KDDI Corp | JP Morgan | (1.587) |
| 2.800 | J-Oil Mills Inc | Citibank | (1.924) | 300 | KeePer Technical Laboratory Co Ltd | Citibank | (695) |
| 700 | J-Oil Mills Inc | HSBC | (375) | (900) | Keihan Holdings Co Ltd | HSBC | 2.523 |
| 3.200 | J-Oil Mills Inc | JP Morgan | (896) | (200) | Keihan Holdings Co Ltd | JP Morgan | 457 |
| (900) | Joshin Denki Co Ltd | HSBC | 682 | 500 | Keihanshin Building Co Ltd | Citibank | (61) |
| (200) | Joshin Denki Co Ltd | JP Morgan | 99 | 1.900 | Keihanshin Building Co Ltd | HSBC | (1.336) |
| (3.800) | JSR Corp | HSBC | (1.135) | 8.100 | Keihanshin Building Co Ltd | JP Morgan | (5.687) |
| 3.600 | JTEKT Corp | Citibank | (1.444) | 3.900 | Keiryu Corp | HSBC | (1.124) |
| 1.900 | JTEKT Corp | HSBC | (476) | (700) | Keio Corp | Citibank | 2.394 |
| 1.100 | JTEKT Corp | JP Morgan | (275) | (1.500) | Keio Corp | JP Morgan | 4.644 |
| (500) | JTOWER Inc | JP Morgan | 10 | (500) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Citibank | 612 |
| (200) | Juroku Financial Group Inc | Citibank | 59 | (1.600) | Keisei Electric Railway Co Ltd | JP Morgan | (1.172) |
| (100) | Juroku Financial Group Inc | HSBC | 8 | (1.000) | KEIWA Inc | Citibank | 753 |
| (800) | Juroku Financial Group Inc | JP Morgan | 62 | (200) | KEIWA Inc | HSBC | 502 |
| | | | | (2.100) | KEIWA Inc | JP Morgan | 5.267 |
| | | | | (1.400) | Keiyo Bank Ltd | Citibank | 502 |
| | | | | (3.300) | Keiyo Bank Ltd | JP Morgan | 1.543 |
| | | | | (5.000) | Keiyo Co Ltd | Citibank | 2.360 |
| | | | | (5.800) | Keiyo Co Ltd | HSBC | 3.009 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|--------------------------|---------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (10.600) | Keiyo Co Ltd | JP Morgan | 5.431 | 200 | Kose Corp | Citibank | (2.412) |
| 50 | Kenedix Office Investment Corp (REIT) | Citibank | 2.089 | 200 | Kose Corp | HSBC | (3.007) |
| 12 | Kenedix Office Investment Corp (REIT) | HSBC | 8 | 500 | Kose Corp | JP Morgan | (5.670) |
| 31 | Kenedix Office Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 27 | 3.200 | Koshidaka Holdings Co Ltd | Citibank | (739) |
| 1.100 | Kewpie Corp | Citibank | (1.036) | 1.400 | Koshidaka Holdings Co Ltd | HSBC | (305) |
| 5.500 | Kewpie Corp | HSBC | (5.945) | 6.900 | Koshidaka Holdings Co Ltd | JP Morgan | (960) |
| 1.100 | Kewpie Corp | JP Morgan | (1.187) | 200 | Kotobuki Spirits Co Ltd | JP Morgan | 287 |
| (500) | Keyence Corp | Citibank | 11.588 | (900) | KPP Group Holdings Co Ltd | HSBC | 704 |
| (500) | KFC Holdings Japan Ltd | Citibank | 145 | (1.800) | KPP Group Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.407 |
| (1.000) | KFC Holdings Japan Ltd | JP Morgan | 728 | (1.200) | K's Holdings Corp | Citibank | 870 |
| (2.000) | Kinden Corp | Citibank | 1.179 | (2.100) | K's Holdings Corp | HSBC | 1.543 |
| (2.700) | Kinden Corp | HSBC | 1.896 | 7.100 | Kubota Corp | JP Morgan | (10.620) |
| (1.600) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Citibank | 3.732 | (1.700) | Kumiai Chemical Industry Co Ltd | Citibank | 738 |
| (3.800) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | HSBC | 7.326 | (1.100) | Kumiai Chemical Industry Co Ltd | HSBC | 487 |
| (2.900) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | JP Morgan | 5.935 | (800) | Kumiai Chemical Industry Co Ltd | JP Morgan | 354 |
| 6.800 | Kirin Holdings Co Ltd | Citibank | (6.857) | (9.600) | Kura Sushi Inc | Citibank | 7.040 |
| 3.700 | Kirin Holdings Co Ltd | HSBC | (4.647) | (200) | Kura Sushi Inc | HSBC | 328 |
| (10.500) | Kisoji Co Ltd | Citibank | 11.454 | (3.000) | Kura Sushi Inc | JP Morgan | 5.009 |
| (5.100) | Kisoji Co Ltd | HSBC | 6.285 | 21.800 | Kuraray Co Ltd | Citibank | (5.039) |
| (6.400) | Kisoji Co Ltd | JP Morgan | 7.874 | 6.800 | Kuraray Co Ltd | HSBC | 15 |
| (2.100) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | Citibank | 1.385 | 7.100 | Kuraray Co Ltd | JP Morgan | 214 |
| (2.100) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | HSBC | (2.608) | 1.900 | Kureha Corp | Citibank | (7.761) |
| (2.100) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | JP Morgan | (2.615) | 300 | Kurita Water Industries Ltd | Citibank | (620) |
| 6.400 | Kitz Corp | Citibank | (1.061) | (2.200) | KYB Corp | Citibank | 6.590 |
| 4.600 | Kitz Corp | JP Morgan | 1.050 | (1.000) | KYB Corp | HSBC | 703 |
| (2.400) | Kiyo Bank Ltd | Citibank | 2.221 | (200) | KYB Corp | JP Morgan | 112 |
| (4.900) | Kiyo Bank Ltd | HSBC | 7.015 | 1.600 | Kyocera Corp | Citibank | 2.165 |
| (100) | Kiyo Bank Ltd | JP Morgan | 112 | 900 | Kyocera Corp | HSBC | 2.990 |
| 800 | KNT-CT Holdings Co Ltd | Citibank | (842) | 400 | Kyocera Corp | JP Morgan | 1.331 |
| 500 | KNT-CT Holdings Co Ltd | HSBC | (827) | 900 | Kyoei Steel Ltd | Citibank | (448) |
| 1.000 | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (5.687) | 1.600 | Kyoei Steel Ltd | HSBC | (314) |
| 1.900 | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (10.793) | 100 | Kyoei Steel Ltd | JP Morgan | (19) |
| (1.000) | Kobe Bussan Co Ltd | Citibank | 1.785 | (3.100) | Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd | Citibank | 2.866 |
| (2.000) | Kobe Bussan Co Ltd | JP Morgan | 2.356 | (2.700) | Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd | HSBC | 4.686 |
| 7.800 | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Citibank | (7.296) | (3.300) | Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 5.723 |
| 200 | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | HSBC | (268) | (2.700) | Kyorin Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 1.211 |
| 1.100 | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.272) | (800) | Kyorin Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 494 |
| (6.900) | Koito Manufacturing Co Ltd | Citibank | 8.685 | (4.900) | Kyorin Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 1.959 |
| (4.200) | Koito Manufacturing Co Ltd | HSBC | 2.861 | 500 | Kyoritsu Maintenance Co Ltd | HSBC | (2.985) |
| (1.300) | Koito Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | 883 | 400 | Kyoritsu Maintenance Co Ltd | JP Morgan | (2.386) |
| 6.400 | Kokuyo Co Ltd | Citibank | (7.402) | 7.700 | Kyowa Kirin Co Ltd | Citibank | (6.505) |
| 100 | Kokuyo Co Ltd | HSBC | (128) | 4.400 | Kyowa Kirin Co Ltd | HSBC | (14.062) |
| 3.700 | Kokuyo Co Ltd | JP Morgan | (4.724) | 1.800 | Kyowa Kirin Co Ltd | JP Morgan | (5.748) |
| (200) | Komatsu Ltd | HSBC | 156 | (4.000) | Kyudenko Corp | HSBC | (20) |
| 3.400 | KOMEDA Holdings Co Ltd | HSBC | (1.736) | (400) | Kyudenko Corp | JP Morgan | (3) |
| 1.100 | KOMEDA Holdings Co Ltd | JP Morgan | (543) | (6.200) | Kyushu Electric Power Co Inc | Citibank | (68) |
| (3.300) | Komeri Co Ltd | Citibank | 3.874 | (3.900) | Kyushu Electric Power Co Inc | HSBC | (147) |
| (2.700) | Komeri Co Ltd | HSBC | 4.598 | (1.800) | Kyushu Electric Power Co Inc | JP Morgan | (69) |
| 4.000 | Konica Minolta Inc | Citibank | (688) | 500 | Kyushu Financial Group Inc | JP Morgan | (27) |
| 10.500 | Konica Minolta Inc | HSBC | (10.470) | (2.700) | Kyushu Railway Co | Citibank | 3.653 |
| 7.800 | Konica Minolta Inc | JP Morgan | (7.518) | (10.300) | Kyushu Railway Co | HSBC | 18.437 |
| (700) | Konishi Co Ltd | Citibank | 900 | (3.200) | Kyushu Railway Co | JP Morgan | 5.792 |
| (200) | Konishi Co Ltd | HSBC | 240 | 100 | Lacto Japan Co Ltd | JP Morgan | (132) |
| (3.100) | Konishi Co Ltd | JP Morgan | 2.681 | (8) | LaSalle Logiport (REIT) | Citibank | (134) |
| 8.100 | Konoike Transport Co Ltd | Citibank | (10.585) | (18) | LaSalle Logiport (REIT) | HSBC | 258 |
| 5.000 | Konoike Transport Co Ltd | JP Morgan | (6.263) | | | | |
| (1.700) | Kosaido Holdings Co Ltd | Citibank | (44) | | | | |
| (700) | Kosaido Holdings Co Ltd | HSBC | 1.449 | | | | |
| (1.400) | Kosaido Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.895 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-------------------------------|-------------|---|--------------------------|--------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (46) | LaSalle Logiport (REIT) | JP Morgan | 652 | 2.300 | Max Co Ltd | Citibank | (2.656) |
| 200 | Lasertec Corp | HSBC | 4.269 | 1.300 | Max Co Ltd | HSBC | (438) |
| 100 | Lasertec Corp | JP Morgan | 2.162 | 3.500 | Max Co Ltd | JP Morgan | (1.173) |
| (11.300) | Leopalace21 Corp | Citibank | 1.975 | (5.600) | Mazda Motor Corp | JP Morgan | 1.114 |
| (5.000) | Leopalace21 Corp | HSBC | 2.971 | (4.400) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Citibank | 2.715 |
| (21.100) | Leopalace21 Corp | JP Morgan | 13.237 | (4.400) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | HSBC | 9.658 |
| 1.400 | Life Corp | Citibank | (2.895) | (3.600) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | JP Morgan | 7.885 |
| 1.800 | Life Corp | HSBC | (2.749) | 1.000 | MCJ Co Ltd | HSBC | (406) |
| 1.100 | Life Corp | JP Morgan | (1.935) | 1.000 | MCJ Co Ltd | JP Morgan | (329) |
| (3.900) | LIFENET INSURANCE Co | Citibank | 1.493 | (8.700) | Mebuki Financial Group Inc | Citibank | 722 |
| (700) | LIFENET INSURANCE Co | JP Morgan | 1.720 | (24.400) | Mebuki Financial Group Inc | JP Morgan | 4.220 |
| 9.900 | Link And Motivation Inc | Citibank | (3.511) | 500 | MEC Co Ltd | Citibank | 173 |
| 6.300 | Link And Motivation Inc | HSBC | (3.418) | 100 | MEC Co Ltd | HSBC | 321 |
| 12.900 | Link And Motivation Inc | JP Morgan | (7.708) | 500 | Medical Data Vision Co Ltd | JP Morgan | (557) |
| 400 | Lion Corp | HSBC | (518) | 4.300 | Medipal Holdings Corp | Citibank | (2.884) |
| 11.900 | Lion Corp | JP Morgan | (15.403) | 400 | Medipal Holdings Corp | HSBC | (107) |
| 2.200 | LITALICO Inc | Citibank | (1.737) | 5.800 | Medipal Holdings Corp | JP Morgan | 127 |
| 900 | LITALICO Inc | HSBC | 28 | (2.000) | MedPeer Inc | Citibank | 472 |
| 500 | LITALICO Inc | JP Morgan | (1.517) | (1.000) | MedPeer Inc | HSBC | 208 |
| 4.000 | Lixil Corp | Citibank | (3.975) | (1.000) | Megachips Corp | Citibank | (238) |
| 3.100 | Lixil Corp | HSBC | (5.890) | (2.000) | Megachips Corp | HSBC | (427) |
| 1.300 | M&A Capital Partners Co Ltd | Citibank | (2.742) | (1.600) | Megachips Corp | JP Morgan | (952) |
| 1.300 | M&A Capital Partners Co Ltd | HSBC | (2.637) | 4.500 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | Citibank | (5.545) |
| 900 | M&A Capital Partners Co Ltd | JP Morgan | (3.336) | 600 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | HSBC | (482) |
| 3.100 | Mabuchi Motor Co Ltd | Citibank | (5.798) | 11.300 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | JP Morgan | (21.355) |
| 100 | Macbee Planet Inc | Citibank | (1.166) | 100 | Meidensha Corp | HSBC | (21) |
| 100 | Macbee Planet Inc | JP Morgan | (927) | 100 | Meidensha Corp | JP Morgan | (31) |
| 800 | Macnica Holdings Inc | Citibank | 874 | (600) | Meiko Electronics Co Ltd | Citibank | 812 |
| 900 | Macnica Holdings Inc | JP Morgan | 7.263 | 2.400 | Meiko Network Japan Co Ltd | Citibank | (685) |
| 400 | Maeda Kosen Co Ltd | JP Morgan | (1.135) | 4.800 | Meisei Industrial Co Ltd | Citibank | (913) |
| 500 | Makino Milling Machine Co Ltd | HSBC | 1.205 | 900 | Meisei Industrial Co Ltd | JP Morgan | (204) |
| 1.000 | Makino Milling Machine Co Ltd | JP Morgan | 2.294 | 1.700 | Meitec Corp | Citibank | (1.220) |
| (1.300) | Makita Corp | Citibank | 1.969 | 800 | Meitec Corp | HSBC | (228) |
| (700) | Makita Corp | HSBC | 788 | 3.200 | Meitec Corp | JP Morgan | (839) |
| (1.800) | Makita Corp | JP Morgan | 748 | 500 | Meico Holdings Inc | HSBC | (1.481) |
| (500) | Management Solutions Co Ltd | Citibank | 1.144 | (200) | Menicon Co Ltd | Citibank | 157 |
| (500) | Management Solutions Co Ltd | JP Morgan | 1.471 | (400) | Menicon Co Ltd | HSBC | 459 |
| 3.600 | Mandom Corp | Citibank | (5.153) | (400) | Menicon Co Ltd | JP Morgan | 455 |
| 3.900 | Mandom Corp | JP Morgan | (5.293) | (200) | Mercari Inc | Citibank | 119 |
| 3.000 | Mani Inc | Citibank | (2.720) | (2.500) | Mercari Inc | HSBC | (1.152) |
| 1.200 | Mani Inc | HSBC | (1.448) | 1.600 | METAWATER Co Ltd | HSBC | (1.952) |
| 3.400 | Mani Inc | JP Morgan | (3.503) | (500) | Micronics Japan Co Ltd | JP Morgan | (1.677) |
| (900) | Marubeni Corp | Citibank | 209 | 5.100 | Mie Kotsu Group Holdings Inc | Citibank | (1.114) |
| 1.500 | Maruha Nichiro Corp | Citibank | (1.823) | 6.800 | Mie Kotsu Group Holdings Inc | JP Morgan | (3.712) |
| 900 | Maruha Nichiro Corp | HSBC | (1.576) | (100) | Milbon Co Ltd | Citibank | 578 |
| 1.100 | Maruha Nichiro Corp | JP Morgan | (1.079) | 4.500 | Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd | Citibank | 1.180 |
| 2.500 | Marui Group Co Ltd | JP Morgan | 1.928 | 1.100 | Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd | HSBC | 1.681 |
| 700 | Maruichi Steel Tube Ltd | Citibank | (715) | 5.600 | Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd | JP Morgan | 8.571 |
| 200 | Maruichi Steel Tube Ltd | JP Morgan | (252) | (3.300) | MINEBEA MITSUMI Inc | Citibank | (205) |
| (100) | Maruwa Co Ltd | HSBC | (814) | 1.200 | MIRAIT ONE corp | Citibank | (301) |
| 2.000 | Maruzen Showa Unyu Co Ltd | Citibank | (4.494) | 500 | MIRAIT ONE corp | JP Morgan | (316) |
| 800 | Maruzen Showa Unyu Co Ltd | HSBC | (34) | 1.200 | MISUMI Group Inc | Citibank | (1.259) |
| 300 | Matsuda Sangyo Co Ltd | Citibank | (196) | 200 | Mitani Sekisan Co Ltd | Citibank | (413) |
| 800 | Matsuda Sangyo Co Ltd | HSBC | (865) | 15.600 | Mitsubishi Chemical Group Corp | HSBC | (3.782) |
| 1.700 | Matsui Securities Co Ltd | HSBC | (397) | 11.900 | Mitsubishi Chemical Group Corp | JP Morgan | (2.918) |
| 7.200 | Matsui Securities Co Ltd | JP Morgan | (1.310) | | | | |
| (700) | MatsukiyoCocokara & Co Ltd | JP Morgan | 316 | | | | |
| (100) | Matsuyafoods Holdings Co Ltd | Citibank | 190 | | | | |
| (700) | Matsuyafoods Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.110 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|-------------|---|--------------------------|------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1.200 | Mitsubishi Corp | HSBC | 101 | (4.100) | MIXI Inc | Citibank | 5.599 |
| 1.300 | Mitsubishi Corp | JP Morgan | 363 | (7.300) | MIXI Inc | JP Morgan | 13.776 |
| 100 | Mitsubishi Electric Corp | HSBC | 2 | 2.300 | Mizuho Financial Group Inc | Citibank | (710) |
| 9.600 | Mitsubishi Electric Corp | JP Morgan | 186 | 4.200 | Mizuho Financial Group Inc | JP Morgan | 88 |
| 1.800 | Mitsubishi Estate Co Ltd | Citibank | (994) | 4.000 | Mizuho Leasing Co Ltd | Citibank | (6.510) |
| 3.600 | Mitsubishi Estate Co Ltd | HSBC | (2.948) | (600) | Mizuno Corp | Citibank | 496 |
| 15.000 | Mitsubishi Estate Co Ltd | JP Morgan | (12.262) | (300) | Mizuno Corp | HSBC | 18 |
| (38) | Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 1.362 | (500) | Mizuno Corp | JP Morgan | 321 |
| 100 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Citibank | (40) | (300) | Mochida Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 751 |
| 24.800 | Mitsubishi HC Capital Inc | Citibank | (4.058) | (100) | Mochida Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 159 |
| 4.700 | Mitsubishi HC Capital Inc | HSBC | 783 | 1.300 | Modec Inc | Citibank | (903) |
| 22.200 | Mitsubishi HC Capital Inc | JP Morgan | 3.203 | 1.500 | Modec Inc | HSBC | (1.918) |
| 2.100 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Citibank | 1.433 | 1.400 | Modec Inc | JP Morgan | (1.789) |
| 800 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | HSBC | 2.890 | (16.000) | Monex Group Inc | Citibank | 1.857 |
| 200 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | JP Morgan | 871 | (8.400) | Monex Group Inc | HSBC | 1.861 |
| 2.700 | Mitsubishi Logisnext Co Ltd | Citibank | (564) | (13.600) | Monex Group Inc | JP Morgan | 4.247 |
| 1.800 | Mitsubishi Logisnext Co Ltd | HSBC | 585 | (900) | Money Forward Inc | JP Morgan | (937) |
| 1.200 | Mitsubishi Logistics Corp | Citibank | (1.927) | 1.400 | Monogatari Corp | Citibank | (1.999) |
| 1.100 | Mitsubishi Logistics Corp | HSBC | (1.366) | 1.100 | Monogatari Corp | HSBC | (646) |
| 3.200 | Mitsubishi Logistics Corp | JP Morgan | (4.183) | 1.400 | Monogatari Corp | JP Morgan | 708 |
| 11.900 | Mitsubishi Materials Corp | Citibank | (7.042) | 3.400 | MonotaRO Co Ltd | HSBC | 2.072 |
| 1.600 | Mitsubishi Materials Corp | HSBC | (660) | (25) | Mori Hills Investment Corp (REIT) | HSBC | 1.003 |
| 5.300 | Mitsubishi Materials Corp | JP Morgan | (1.793) | (20) | Mori Hills Investment Corp (REIT) | JP Morgan | 800 |
| (4.500) | Mitsubishi Pencil Co Ltd | Citibank | 4.716 | (2.300) | Morinaga & Co Ltd | JP Morgan | (2.787) |
| (1.800) | Mitsubishi Pencil Co Ltd | HSBC | 2.760 | (200) | Morinaga Milk Industry Co Ltd | Citibank | 518 |
| (500) | Mitsubishi Pencil Co Ltd | JP Morgan | 716 | (1.500) | Morinaga Milk Industry Co Ltd | HSBC | 2.728 |
| 5.000 | Mitsubishi Shokuhin Co Ltd | Citibank | (6.706) | (1.800) | Morinaga Milk Industry Co Ltd | JP Morgan | 5.814 |
| 300 | Mitsubishi Shokuhin Co Ltd | HSBC | (192) | 1.500 | MOS Food Services Inc | Citibank | (1.701) |
| 3.500 | Mitsubishi Shokuhin Co Ltd | JP Morgan | (2.224) | 3.100 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Citibank | (1.700) |
| 38.600 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | Citibank | (1.811) | 4.200 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | HSBC | 4.300 |
| 5.000 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | HSBC | 1.622 | 8.300 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | JP Morgan | 5.666 |
| (2.400) | Mitsuboshi Belting Ltd | Citibank | 2.898 | (4.700) | m-up Holdings Inc | Citibank | 6.419 |
| (1.400) | Mitsuboshi Belting Ltd | HSBC | 1.198 | (800) | m-up Holdings Inc | HSBC | 863 |
| (2.800) | Mitsuboshi Belting Ltd | JP Morgan | 2.768 | (400) | m-up Holdings Inc | JP Morgan | 431 |
| 900 | Mitsui & Co Ltd | Citibank | (621) | (1.400) | Murata Manufacturing Co Ltd | Citibank | (167) |
| 5.700 | Mitsui & Co Ltd | JP Morgan | (38) | (400) | Murata Manufacturing Co Ltd | HSBC | 236 |
| (2.100) | Mitsui Chemicals Inc | Citibank | 1.805 | (1.500) | Murata Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | (566) |
| (700) | Mitsui Chemicals Inc | HSBC | 301 | (4.600) | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | Citibank | 5.607 |
| (2.000) | Mitsui Chemicals Inc | JP Morgan | 853 | (3.400) | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | JP Morgan | 4.827 |
| (200) | Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd | HSBC | (180) | (1.000) | Musashino Bank Ltd | Citibank | 226 |
| (2.700) | Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd | JP Morgan | (2.431) | (3.600) | Musashino Bank Ltd | HSBC | 2.828 |
| 4.300 | Mitsui Fudosan Co Ltd | Citibank | (3.624) | (400) | Musashino Bank Ltd | JP Morgan | 101 |
| 1.300 | Mitsui Fudosan Co Ltd | HSBC | (842) | 800 | Nabtesco Corp | Citibank | (851) |
| 2.600 | Mitsui Fudosan Co Ltd | JP Morgan | (1.679) | 3.800 | Nabtesco Corp | HSBC | (4.521) |
| (12) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | Citibank | 899 | 1.900 | Nabtesco Corp | JP Morgan | (2.403) |
| (32) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | HSBC | 9.236 | (200) | Nachi-Fujikoshi Corp | HSBC | 288 |
| (28) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | JP Morgan | 8.069 | (900) | Nachi-Fujikoshi Corp | JP Morgan | 1.336 |
| (1.100) | Mitsui High-Tec Inc | Citibank | (1.723) | (4.200) | Nafco Co Ltd | Citibank | 3.308 |
| (600) | Mitsui High-Tec Inc | HSBC | (3.157) | (2.200) | Nafco Co Ltd | HSBC | 2.836 |
| (2.800) | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd | HSBC | 7.373 | (2.400) | Nafco Co Ltd | JP Morgan | 3.003 |
| (200) | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd | JP Morgan | 526 | (800) | Nagawa Co Ltd | Citibank | 2.788 |
| (3.100) | Mitsui OSK Lines Ltd | Citibank | 1.072 | (300) | Nagawa Co Ltd | HSBC | 1.108 |
| 100 | Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd | HSBC | (47) | (200) | Nagawa Co Ltd | JP Morgan | 738 |
| (1.200) | Miura Co Ltd | HSBC | 1.023 | 1.700 | Nakanishi Inc | Citibank | (46) |
| (1.200) | Miura Co Ltd | JP Morgan | 610 | 200 | Nakanishi Inc | HSBC | (31) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|-------------|---|--------------------------|------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 800 | Nakanishi Inc | JP Morgan | (67) | 200 | Nippon Ceramic Co Ltd | HSBC | (503) |
| (1.800) | Nankai Electric Railway Co Ltd | Citibank | 2.577 | (900) | Nippon Chemi-Con Corp | HSBC | 6.246 |
| (4.400) | Nankai Electric Railway Co Ltd | HSBC | 5.838 | (3.100) | Nippon Chemi-Con Corp | JP Morgan | 21.509 |
| (3.100) | Nankai Electric Railway Co Ltd | JP Morgan | 4.105 | (10.700) | Nippon Denko Co Ltd | JP Morgan | 7.450 |
| (2.900) | Nanto Bank Ltd | HSBC | 3.284 | (5.500) | Nippon Electric Glass Co Ltd | Citibank | 1.599 |
| (4.100) | Nanto Bank Ltd | JP Morgan | 4.679 | (7.100) | Nippon Electric Glass Co Ltd | HSBC | 2.193 |
| 5.700 | NEC Networks & System Integration Corp | HSBC | 558 | (7.400) | Nippon Electric Glass Co Ltd | JP Morgan | 2.270 |
| 2.000 | NEC Networks & System Integration Corp | JP Morgan | 199 | 1.200 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | Citibank | (5.658) |
| 1.200 | NET One Systems Co Ltd | Citibank | (1.590) | 1.000 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | HSBC | (4.635) |
| 2.000 | NET One Systems Co Ltd | HSBC | (3.629) | 600 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | JP Morgan | (2.777) |
| 1.000 | NET One Systems Co Ltd | JP Morgan | (1.812) | 1.200 | Nippon Gas Co Ltd | Citibank | (1.289) |
| 2.000 | Neturen Co Ltd | Citibank | (563) | 2.600 | Nippon Gas Co Ltd | HSBC | (1.674) |
| 2.300 | Neturen Co Ltd | JP Morgan | 2.207 | 2.600 | Nippon Gas Co Ltd | JP Morgan | (1.670) |
| 6.500 | Nexon Co Ltd | Citibank | (10.903) | 2 | NIPPON Investment Corp (REIT) | HSBC | (138) |
| 600 | Nexon Co Ltd | JP Morgan | (1.082) | (5.300) | Nippon Kayaku Co Ltd | Citibank | 3.590 |
| (300) | Nextage Co Ltd | Citibank | (53) | (9.400) | Nippon Kayaku Co Ltd | JP Morgan | 9.053 |
| (900) | Nextage Co Ltd | HSBC | 470 | 10.500 | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd | Citibank | (5.752) |
| (1.800) | NGK Insulators Ltd | JP Morgan | 1.658 | 8.300 | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd | HSBC | (8.374) |
| 900 | NH Foods Ltd | Citibank | (934) | 13.600 | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd | JP Morgan | (11.779) |
| (6.800) | NHK Spring Co Ltd | Citibank | 3.980 | 4.300 | Nippon Paint Holdings Co Ltd | Citibank | (3.976) |
| (10.600) | NHK Spring Co Ltd | HSBC | 7.908 | 10.700 | Nippon Paint Holdings Co Ltd | HSBC | (12.211) |
| (4.000) | NHK Spring Co Ltd | JP Morgan | 2.974 | 22.100 | Nippon Parking Development Co Ltd | Citibank | (1.902) |
| 100 | Nichias Corp | HSBC | (146) | 10.300 | Nippon Parking Development Co Ltd | HSBC | (1.312) |
| 1.200 | Nichias Corp | JP Morgan | (1.755) | 6.100 | Nippon Parking Development Co Ltd | JP Morgan | (812) |
| 1.200 | Nichiden Corp | Citibank | (1.177) | 400 | Nippon Pillar Packing Co Ltd | HSBC | 485 |
| 1.700 | Nichiden Corp | HSBC | 565 | 700 | Nippon Road Co Ltd | JP Morgan | (693) |
| 5.100 | Nichiden Corp | JP Morgan | 1.704 | (900) | Nippon Sanso Holdings Corp | Citibank | 669 |
| 1.000 | Nichirei Corp | Citibank | (1.331) | (2.000) | Nippon Sanso Holdings Corp | HSBC | (3.706) |
| (2.400) | Nifco Inc | HSBC | 4.638 | (1.100) | Nippon Sanso Holdings Corp | JP Morgan | (2.189) |
| (1.200) | Nifco Inc | JP Morgan | 2.315 | 2.500 | Nippon Seiki Co Ltd | HSBC | (822) |
| (2.100) | Nihon Kohden Corp | Citibank | 3.740 | 1.400 | Nippon Seiki Co Ltd | JP Morgan | (484) |
| (700) | Nihon Kohden Corp | HSBC | 2.037 | (100) | Nippon Sharyo Ltd | Citibank | 111 |
| (1.800) | Nihon Kohden Corp | JP Morgan | 5.231 | (700) | Nippon Sharyo Ltd | HSBC | 1.113 |
| 2.300 | Nihon M&A Center Holdings Inc | Citibank | (1.772) | 2.600 | Nippon Sheet Glass Co Ltd | Citibank | (775) |
| (5.700) | Nihon Nohyaku Co Ltd | HSBC | 4.889 | 400 | Nippon Shinyaku Co Ltd | HSBC | (269) |
| (1.700) | Nihon Nohyaku Co Ltd | JP Morgan | 1.457 | 1.300 | Nippon Shinyaku Co Ltd | JP Morgan | (866) |
| 2.300 | Nihon Parkerizing Co Ltd | HSBC | (1.408) | 400 | Nippon Shokubai Co Ltd | HSBC | (1.555) |
| 4.700 | Nihon Parkerizing Co Ltd | JP Morgan | (2.605) | 500 | Nippon Shokubai Co Ltd | JP Morgan | (1.941) |
| 5.100 | Nikkiso Co Ltd | Citibank | (2.528) | (7.600) | Nippon Signal Company Ltd | JP Morgan | 8.962 |
| 2.000 | Nikkiso Co Ltd | JP Morgan | (1.816) | (300) | Nippon Soda Co Ltd | HSBC | 260 |
| (700) | Nikko Holdings Co Ltd | Citibank | 1.003 | (500) | Nippon Soda Co Ltd | JP Morgan | 478 |
| (200) | Nikko Holdings Co Ltd | HSBC | 240 | 4.800 | Nippon Steel Corp | Citibank | (6.775) |
| (1.100) | Nikko Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.318 | (500) | Nippon Steel Trading Corp | HSBC | 93 |
| 6.200 | Nikon Corp | JP Morgan | 1.965 | (2.100) | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Citibank | 4.793 |
| (700) | Nintendo Co Ltd | Citibank | 1.130 | (1.700) | Nippon Telegraph & Telephone Corp | HSBC | 4.636 |
| (400) | Nintendo Co Ltd | JP Morgan | 78 | (5.700) | Nippon Telegraph & Telephone Corp | JP Morgan | 12.832 |
| 1.800 | Nippn Corp | Citibank | (1.440) | | | | |
| 1.200 | Nippn Corp | HSBC | (966) | | | | |
| 500 | Nippn Corp | JP Morgan | (402) | | | | |
| (8) | Nippon Accommodations Fund Inc (REIT) | HSBC | 330 | | | | |
| (5) | Nippon Accommodations Fund Inc (REIT) | JP Morgan | 204 | | | | |
| (42) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | Citibank | 383 | | | | |
| (16) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | HSBC | 2.048 | | | | |
| (25) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | JP Morgan | 4.477 | | | | |
| (3.500) | Nippon Carbon Co Ltd | Citibank | 2.973 | | | | |
| (2.200) | Nippon Carbon Co Ltd | HSBC | 226 | | | | |
| (1.700) | Nippon Carbon Co Ltd | JP Morgan | 168 | | | | |
| 300 | Nippon Ceramic Co Ltd | Citibank | (496) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-------------------------------------|-------------|---|--------------------------|----------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.000) | Nippon Television Holdings Inc | Citibank | 406 | (300) | NOF Corp | JP Morgan | 1.320 |
| (2.200) | Nippon Television Holdings Inc | HSBC | 126 | 500 | Nohmi Bosai Ltd | Citibank | (555) |
| (300) | Nippon Television Holdings Inc | JP Morgan | 17 | 900 | Nohmi Bosai Ltd | HSBC | (953) |
| 31.400 | Nippon Thompson Co Ltd | Citibank | (9.839) | 100 | Nohmi Bosai Ltd | JP Morgan | (106) |
| 10.700 | Nippon Thompson Co Ltd | HSBC | (4.389) | (800) | Nojima Corp | Citibank | 431 |
| 2.600 | Nippon Thompson Co Ltd | JP Morgan | (1.153) | (500) | Nojima Corp | HSBC | 575 |
| (3.700) | Nippon Yusen KK | Citibank | 2.921 | (5.800) | Nojima Corp | JP Morgan | 8.000 |
| (100) | Nippon Yusen KK | HSBC | 217 | (4.700) | NOK Corp | Citibank | 2.717 |
| (3.300) | Nipro Corp | Citibank | 1.111 | (10.500) | NOK Corp | HSBC | 5.430 |
| (10.000) | Nipro Corp | JP Morgan | 4.909 | (4.400) | NOK Corp | JP Morgan | 2.269 |
| (700) | Nishimatsu Construction Co Ltd | Citibank | 612 | (19.300) | Nomura Holdings Inc | HSBC | 1.019 |
| (1.400) | Nishimatsu Construction Co Ltd | HSBC | 3.646 | 24 | Nomura Real Estate | | |
| (400) | Nishimatsu Construction Co Ltd | JP Morgan | 716 | | Master Fund Inc (REIT) | Citibank | (369) |
| (6.000) | Nishimatsuya Chain Co Ltd | Citibank | 329 | 13 | Nomura Real Estate | | |
| (200) | Nishimatsuya Chain Co Ltd | HSBC | 20 | | Master Fund Inc (REIT) | HSBC | (355) |
| (3.800) | Nishimatsuya Chain Co Ltd | JP Morgan | 380 | 29 | Nomura Real Estate | | |
| 11.400 | Nishi-Nippon Financial Holdings Inc | Citibank | (2.123) | | Master Fund Inc (REIT) | JP Morgan | (787) |
| (300) | Nishi-Nippon Railroad Co Ltd | Citibank | 366 | (1.800) | Nomura Research Institute Ltd | HSBC | 1.299 |
| (900) | Nishi-Nippon Railroad Co Ltd | HSBC | 1.558 | 2.800 | Noritsu Koki Co Ltd | Citibank | (3.193) |
| (200) | Nishi-Nippon Railroad Co Ltd | JP Morgan | 346 | 1.800 | Noritsu Koki Co Ltd | HSBC | (1.399) |
| (2.400) | Nishio Holdings Co Ltd | Citibank | 3.098 | 4.700 | Noritsu Koki Co Ltd | JP Morgan | (5.578) |
| (300) | Nishio Holdings Co Ltd | HSBC | 457 | 1.600 | Noritz Corp | Citibank | (1.161) |
| (2.600) | Nishio Holdings Co Ltd | JP Morgan | 2.908 | 1.300 | Noritz Corp | HSBC | (1.859) |
| (400) | Nissan Chemical Corp | HSBC | (68) | 6.800 | Noritz Corp | JP Morgan | (9.713) |
| (7.600) | Nissan Shatai Co Ltd | Citibank | 4.673 | 200 | NS Solutions Corp | Citibank | (184) |
| (7.900) | Nissan Shatai Co Ltd | HSBC | 9.152 | 500 | NS Solutions Corp | HSBC | (83) |
| (3.400) | Nissan Shatai Co Ltd | JP Morgan | 3.936 | 800 | NS Solutions Corp | JP Morgan | (130) |
| (100) | Nissei ASB Machine Co Ltd | Citibank | 160 | (500) | NS United Kaiun Kaisha Ltd | Citibank | 561 |
| (300) | Nissei ASB Machine Co Ltd | HSBC | 1.067 | (200) | NS United Kaiun Kaisha Ltd | JP Morgan | 695 |
| (400) | Nissei ASB Machine Co Ltd | JP Morgan | 1.421 | 2.600 | NSD Co Ltd | Citibank | (1.299) |
| (6.100) | Nissha Co Ltd | Citibank | 4.477 | 400 | NSD Co Ltd | HSBC | 56 |
| (1.800) | Nissha Co Ltd | HSBC | 4.423 | 5.200 | NSD Co Ltd | JP Morgan | 449 |
| (5.500) | Nissha Co Ltd | JP Morgan | 13.508 | (9.200) | NSK Ltd | Citibank | 2.137 |
| 200 | Nisshin Oillio Group Ltd | Citibank | (384) | (11.700) | NSK Ltd | HSBC | 1.105 |
| 5.400 | Nisshin Seifun Group Inc | Citibank | (3.605) | (7.600) | NSK Ltd | JP Morgan | (300) |
| 2.100 | Nisshin Seifun Group Inc | HSBC | 359 | 7.800 | NTN Corp | HSBC | (1.457) |
| 1.300 | Nisshin Seifun Group Inc | JP Morgan | 224 | (5.400) | NTT Data Corp | JP Morgan | (2.398) |
| 200 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | Citibank | (179) | 2.400 | Obara Group Inc | Citibank | (4.032) |
| 11.600 | Nissui Corp | Citibank | (2.389) | 500 | Obara Group Inc | HSBC | (218) |
| 15.800 | Nissui Corp | HSBC | 749 | 4.000 | Obara Group Inc | JP Morgan | (9.374) |
| 5.000 | Nissui Corp | JP Morgan | 240 | (6.000) | Obayashi Corp | HSBC | 2.329 |
| (500) | Nitori Holdings Co Ltd | Citibank | 6.228 | (8.100) | Obayashi Corp | JP Morgan | 1.260 |
| (200) | Nitori Holdings Co Ltd | HSBC | 1.358 | 800 | OBIC Business Consultants Co Ltd | Citibank | (2.577) |
| (500) | Nitori Holdings Co Ltd | JP Morgan | 5.963 | 100 | OBIC Business Consultants Co Ltd | HSBC | (179) |
| 800 | Nittetsu Mining Co Ltd | Citibank | (2.470) | 1.200 | Obic Co Ltd | Citibank | (8.486) |
| 1.000 | Nittetsu Mining Co Ltd | HSBC | (2.393) | 100 | Obic Co Ltd | HSBC | 177 |
| 800 | Nittetsu Mining Co Ltd | JP Morgan | (1.912) | 100 | Obic Co Ltd | JP Morgan | 178 |
| 200 | Nitto Boseki Co Ltd | Citibank | 740 | 2.400 | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Citibank | (2.251) |
| 800 | Nitto Boseki Co Ltd | HSBC | 2.882 | 1.800 | Odakyu Electric Railway Co Ltd | HSBC | (1.419) |
| 500 | Nitto Denko Corp | JP Morgan | 2.805 | 4.700 | Odakyu Electric Railway Co Ltd | JP Morgan | (2.656) |
| (200) | Nitto Kogyo Corp | HSBC | (440) | (1.600) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | Citibank | 1.017 |
| 3.600 | Nitto Kohki Co Ltd | Citibank | (4.045) | (2.400) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | HSBC | 1.783 |
| 900 | Nitto Kohki Co Ltd | HSBC | (906) | (4.400) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | JP Morgan | 3.263 |
| 1.000 | Nitto Kohki Co Ltd | JP Morgan | (1.005) | 1.900 | Ohsho Food Service Corp | Citibank | (2.277) |
| 1.500 | Nittoku Co Ltd | Citibank | (2.658) | 1.400 | Ohsho Food Service Corp | JP Morgan | (1.125) |
| 400 | Nittoku Co Ltd | JP Morgan | (688) | 600 | Oiles Corp | HSBC | 274 |
| 200 | Noevir Holdings Co Ltd | Citibank | (532) | 2.600 | Oiles Corp | JP Morgan | 317 |
| 500 | Noevir Holdings Co Ltd | HSBC | (1.989) | (1.000) | Oisix ra daichi Inc | Citibank | 3.347 |
| 400 | Noevir Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.316) | (2.400) | Oisix ra daichi Inc | JP Morgan | 7.692 |
| | | | | 100 | Okamoto Industries Inc | Citibank | (143) |
| | | | | 100 | Okamoto Industries Inc | HSBC | (167) |
| | | | | 4.800 | Okamura Corp | JP Morgan | 3.943 |
| | | | | (7.800) | Okasan Securities Group Inc | Citibank | 1.033 |
| | | | | (400) | Okasan Securities Group Inc | HSBC | 71 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|-------------|---|--------------------------|---|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (101.900) | Okasan Securities Group Inc | JP Morgan | 6.383 | 300 | PAL GROUP Holdings Co Ltd | Citibank | (251) |
| 2.600 | Oki Electric Industry Co Ltd | Citibank | (703) | (700) | Pan Pacific International Holdings Corp | HSBC | 1.228 |
| 1.800 | Oki Electric Industry Co Ltd | HSBC | 102 | (17.800) | Panasonic Holdings Corp | Citibank | 4.936 |
| (5.100) | Okinawa Cellular Telephone Co | JP Morgan | 8.397 | (2.000) | Panasonic Holdings Corp | HSBC | (1.430) |
| 600 | Okinawa Financial Group Inc | Citibank | (375) | 3.300 | Park24 Co Ltd | HSBC | (3.461) |
| 4.500 | Okinawa Financial Group Inc | JP Morgan | (326) | 1.800 | Park24 Co Ltd | JP Morgan | (1.885) |
| (100) | OKUMA Corp | Citibank | (116) | 500 | Pasona Group Inc | JP Morgan | (672) |
| (2.100) | OKUMA Corp | HSBC | (5.109) | 3.600 | Penta-Ocean Construction Co Ltd | JP Morgan | 121 |
| (1.900) | OKUMA Corp | JP Morgan | (4.632) | 1.800 | Persol Holdings Co Ltd | HSBC | (2.914) |
| 4.200 | Olympus Corp | Citibank | (6.646) | (300) | Pharma Foods International Co Ltd | Citibank | 87 |
| 500 | Olympus Corp | HSBC | (1.440) | (100) | Pharma Foods International Co Ltd | HSBC | (9) |
| 800 | Olympus Corp | JP Morgan | (2.302) | (1.900) | Pharma Foods International Co Ltd | JP Morgan | 399 |
| 1.000 | Omron Corp | Citibank | (1.681) | 700 | PHC Holdings Corp | Citibank | 3 |
| 2.900 | Omron Corp | HSBC | (1.283) | 400 | PHC Holdings Corp | HSBC | (78) |
| 2.600 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (1.467) | 1.000 | PHC Holdings Corp | JP Morgan | (194) |
| 2.300 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (3.775) | 900 | Pigeon Corp | Citibank | (1.233) |
| 7.300 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (11.964) | 700 | Pigeon Corp | HSBC | (1.083) |
| 8.500 | Onward Holdings Co Ltd | Citibank | (2.230) | 200 | Pilot Corp | Citibank | (657) |
| 4.200 | Onward Holdings Co Ltd | HSBC | (959) | 400 | Pilot Corp | JP Morgan | (902) |
| 19.100 | Onward Holdings Co Ltd | JP Morgan | (4.362) | (1.000) | PKSHA Technology Inc | HSBC | (5.092) |
| (10.800) | Open Door Inc | Citibank | 20.892 | 3.900 | Plus Alpha Consulting Co Ltd | JP Morgan | 5.092 |
| (100) | Open Door Inc | HSBC | 258 | 4.800 | Pola Orbis Holdings Inc | HSBC | (9.190) |
| (2.000) | Open Door Inc | JP Morgan | 5.167 | 1.200 | Premium Group Co Ltd | JP Morgan | (1.721) |
| (1.500) | Open House Group Co Ltd | HSBC | 5.606 | 2.700 | Pressance Corp | Citibank | (3.590) |
| 2.500 | Open Up Group Inc | JP Morgan | (2.516) | 1.600 | Pressance Corp | JP Morgan | (2.819) |
| 1.000 | Optex Group Co Ltd | HSBC | (1.396) | 13.100 | Prestige International Inc | Citibank | (16) |
| (300) | Optim Corp | Citibank | (79) | 12.800 | Prestige International Inc | HSBC | 50 |
| (400) | Optim Corp | HSBC | (80) | 3.200 | Prestige International Inc | JP Morgan | (15) |
| (500) | Optim Corp | JP Morgan | (125) | (1.900) | Prima Meat Packers Ltd | Citibank | 2.134 |
| (300) | Oporun Co Ltd | HSBC | (73) | (600) | Prima Meat Packers Ltd | HSBC | 1.118 |
| 900 | Oracle Corp Japan | Citibank | (634) | (100) | Prima Meat Packers Ltd | JP Morgan | 142 |
| (5.200) | Organo Corp | Citibank | 1.033 | 3.400 | Raito Kogyo Co Ltd | Citibank | (3.474) |
| (1.400) | Organo Corp | JP Morgan | (3.317) | 2.500 | Raito Kogyo Co Ltd | HSBC | (3.362) |
| (1.600) | Orient Corp | HSBC | 1.362 | 1.800 | Raito Kogyo Co Ltd | JP Morgan | (2.418) |
| (300) | Orient Corp | JP Morgan | 255 | (1.900) | Raiznext Corp | Citibank | 2.141 |
| (400) | Oriental Land Co Ltd | Citibank | 977 | (3.300) | Raiznext Corp | HSBC | 4.088 |
| 1.400 | ORIX Corp | Citibank | (327) | (1.300) | Raiznext Corp | JP Morgan | 1.611 |
| 2.300 | ORIX Corp | HSBC | (582) | (1.800) | Rakus Co Ltd | HSBC | (1.073) |
| 3.200 | ORIX Corp | JP Morgan | (596) | (700) | Rakus Co Ltd | JP Morgan | (429) |
| 31 | Orix JREIT Inc (REIT) | Citibank | 1.395 | (4.200) | Rakuten Bank Ltd | Citibank | 2.337 |
| 29 | Orix JREIT Inc (REIT) | JP Morgan | (3) | (14.400) | Rakuten Bank Ltd | JP Morgan | 7.190 |
| 700 | Oro Co Ltd | Citibank | 166 | (10.800) | Rakuten Group Inc | Citibank | 3.648 |
| 500 | Oro Co Ltd | HSBC | (594) | 1.900 | Recruit Holdings Co Ltd | Citibank | (2.690) |
| 600 | Oro Co Ltd | JP Morgan | (712) | 1.000 | Relia Inc | HSBC | (387) |
| 6.500 | Osaka Gas Co Ltd | Citibank | (5.312) | 600 | Relia Inc | JP Morgan | 6 |
| 1.800 | Osaka Gas Co Ltd | HSBC | (721) | 5.800 | Relo Group Inc | Citibank | (6.166) |
| 9.000 | Osaka Gas Co Ltd | JP Morgan | (7.830) | 200 | Relo Group Inc | HSBC | (122) |
| (2.900) | Osaka Soda Co Ltd | Citibank | 3.068 | 4.300 | Relo Group Inc | JP Morgan | (6.335) |
| (3.600) | Osaka Soda Co Ltd | HSBC | 9.436 | 1.200 | Renasas Electronics Corp | Citibank | 1.471 |
| (1.300) | Osaka Soda Co Ltd | JP Morgan | 2.187 | 300 | Renasas Electronics Corp | JP Morgan | 800 |
| 1.400 | OSAKA Titanium Technologies Co Ltd | HSBC | 601 | (5.500) | Rengo Co Ltd | Citibank | 1.427 |
| 600 | OSAKA Titanium Technologies Co Ltd | JP Morgan | (1.011) | (21.300) | Rengo Co Ltd | HSBC | 11.305 |
| (3.700) | OSG Corp | Citibank | 3.807 | (4.200) | Rengo Co Ltd | JP Morgan | 1.968 |
| (7.100) | OSG Corp | HSBC | 5.862 | (1.000) | RENOVA Inc | Citibank | 695 |
| (1.800) | OSG Corp | JP Morgan | 1.483 | 9.600 | Resona Holdings Inc | Citibank | (1.994) |
| 3.100 | Otsuka Corp | Citibank | (3.537) | 2.600 | Resona Holdings Inc | HSBC | (940) |
| 3.000 | Otsuka Corp | HSBC | (185) | 1.000 | Resona Holdings Inc | JP Morgan | 17 |
| 100 | Otsuka Corp | JP Morgan | (62) | (5.400) | Resonac Holdings Corp | Citibank | 994 |
| 9.100 | Otsuka Holdings Co Ltd | JP Morgan | 18.585 | (4.200) | Resonac Holdings Corp | HSBC | 2.847 |
| 2.300 | Outsourcing Inc | HSBC | (3.555) | 6.100 | Resorttrust Inc | Citibank | (12.646) |
| 3.700 | Outsourcing Inc | JP Morgan | (5.715) | 800 | Resorttrust Inc | JP Morgan | (1.747) |
| 200 | Pacific Industrial Co Ltd | JP Morgan | (90) | (4.800) | Restar Holdings Corp | Citibank | 3.524 |
| (3.700) | Pacific Metals Co Ltd | Citibank | 2.145 | (3.000) | Restar Holdings Corp | HSBC | (501) |
| (1.000) | Pacific Metals Co Ltd | HSBC | 759 | | | | |
| (1.300) | Pacific Metals Co Ltd | JP Morgan | 608 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-----------------------------|-------------|---|--------------------------|------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (2.600) | Restar Holdings Corp | JP Morgan | (598) | (1.300) | Santen Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 557 |
| (1.600) | Retail Partners Co Ltd | Citibank | 1.030 | (1.600) | Santen Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (799) |
| (2.400) | Retail Partners Co Ltd | HSBC | 1.398 | 6.900 | Sanwa Holdings Corp | JP Morgan | 3.062 |
| (3.600) | Retail Partners Co Ltd | JP Morgan | 2.093 | (1.200) | Sanyo Denki Co Ltd | Citibank | 15 |
| (11.600) | Ricoh Co Ltd | Citibank | 1.332 | 900 | Sanyo Special Steel Co Ltd | Citibank | (1.095) |
| (3.100) | Ricoh Co Ltd | HSBC | 77 | 2.600 | Sanyo Special Steel Co Ltd | JP Morgan | (4.191) |
| 5.100 | Ricoh Leasing Co Ltd | JP Morgan | (11.087) | (1.500) | Sapporo Holdings Ltd | HSBC | 1.791 |
| (200) | Riken Keiki Co Ltd | HSBC | 147 | (2.100) | Sapporo Holdings Ltd | JP Morgan | 2.500 |
| 3.800 | Riken Vitamin Co Ltd | Citibank | (3.136) | (1.400) | Sato Holdings Corp | Citibank | 500 |
| 5.900 | Riken Vitamin Co Ltd | JP Morgan | (6.400) | (1.800) | Sato Holdings Corp | JP Morgan | 1.218 |
| (100) | Rinnai Corp | Citibank | 238 | 3.300 | Sawai Group Holdings Co Ltd | Citibank | (11.485) |
| 2.600 | Riso Kyoiku Co Ltd | JP Morgan | 258 | 1.500 | Sawai Group Holdings Co Ltd | HSBC | (8.501) |
| (1.200) | Rohm Co Ltd | HSBC | 849 | 3.500 | Sawai Group Holdings Co Ltd | JP Morgan | (19.825) |
| (100) | Rohm Co Ltd | JP Morgan | 195 | (400) | SB Technology Corp | HSBC | 483 |
| (1.200) | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (418) | (600) | SBI Shinsei Bank Ltd | Citibank | 203 |
| (1.800) | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (632) | (3.300) | SBI Shinsei Bank Ltd | HSBC | (5.657) |
| (1.300) | Rorze Corp | Citibank | 5.783 | (2.100) | SBI Shinsei Bank Ltd | JP Morgan | (4.178) |
| (400) | Rorze Corp | HSBC | (987) | (16.700) | SBI Sumishin Net Bank Ltd | Citibank | 7.718 |
| (200) | Rorze Corp | JP Morgan | (645) | (800) | SBS Holdings Inc | Citibank | 1.510 |
| (6.800) | Round One Corp | Citibank | (656) | (1.400) | SBS Holdings Inc | JP Morgan | 3.204 |
| 1.500 | Royal Holdings Co Ltd | Citibank | (2.553) | (1.000) | SCREEN Holdings Co Ltd | JP Morgan | (21.286) |
| 2.900 | Royal Holdings Co Ltd | HSBC | (5.448) | (1.400) | Scroll Corp | Citibank | 280 |
| 6.600 | Royal Holdings Co Ltd | JP Morgan | (12.384) | (100) | Scroll Corp | HSBC | (28) |
| 3.100 | Ryohin Keikaku Co Ltd | Citibank | (3.659) | (4.700) | Scroll Corp | JP Morgan | (1.321) |
| 2.200 | Ryohin Keikaku Co Ltd | HSBC | (2.133) | 600 | SCSK Corp | HSBC | 97 |
| 1.900 | Ryohin Keikaku Co Ltd | JP Morgan | (1.399) | 2.600 | SCSK Corp | JP Morgan | 424 |
| 1.300 | Ryosan Co Ltd | Citibank | 1.478 | (600) | Secom Co Ltd | JP Morgan | (211) |
| 600 | Ryosan Co Ltd | JP Morgan | 1.538 | 4.200 | Sega Sammy Holdings Inc | Citibank | (2.855) |
| 2.800 | Ryoyo Electro Corp | Citibank | 11 | 2.200 | Sega Sammy Holdings Inc | HSBC | (1.768) |
| 400 | Ryoyo Electro Corp | HSBC | 108 | 2.700 | Sega Sammy Holdings Inc | JP Morgan | (1.989) |
| 1.200 | Ryoyo Electro Corp | JP Morgan | 208 | 300 | Seibu Holdings Inc | Citibank | (342) |
| 1.000 | S Foods Inc | Citibank | (1.240) | 5.500 | Seibu Holdings Inc | HSBC | (7.499) |
| 1.700 | S Foods Inc | HSBC | (1.711) | (900) | Seiko Epson Corp | Citibank | 458 |
| 2.800 | S Foods Inc | JP Morgan | (2.907) | (300) | Seiko Epson Corp | HSBC | 60 |
| 500 | Saibu Gas Holdings Co Ltd | Citibank | (234) | (3.900) | Seiko Epson Corp | JP Morgan | 771 |
| 400 | Saibu Gas Holdings Co Ltd | JP Morgan | (141) | (2.000) | Seiko Group Corp | Citibank | 706 |
| (100) | Saizeriya Co Ltd | Citibank | 93 | (700) | Seiko Group Corp | HSBC | 2.244 |
| (1.300) | Saizeriya Co Ltd | HSBC | 547 | (4.300) | Seiko Group Corp | JP Morgan | 7.397 |
| 2.500 | Sakai Moving Service Co Ltd | Citibank | (6.255) | (4.100) | Seino Holdings Co Ltd | Citibank | 2.535 |
| 1.200 | Sakai Moving Service Co Ltd | HSBC | (4.584) | (1.500) | Seino Holdings Co Ltd | HSBC | (271) |
| 2.400 | Sakai Moving Service Co Ltd | JP Morgan | (9.158) | (3.500) | Seino Holdings Co Ltd | JP Morgan | (636) |
| 600 | Sakata INX Corp | HSBC | (268) | 6.500 | Seiren Co Ltd | Citibank | 819 |
| 1.100 | Sakata INX Corp | JP Morgan | (216) | 2.400 | Seiren Co Ltd | HSBC | (2.888) |
| (2.700) | SAMTY Co Ltd | Citibank | 2.416 | 4.000 | Seiren Co Ltd | JP Morgan | (4.805) |
| (2.300) | SAMTY Co Ltd | HSBC | 2.455 | (3.300) | Sekisui Chemical Co Ltd | HSBC | 455 |
| (12.200) | SAMTY Co Ltd | JP Morgan | 13.357 | (165) | Sekisui House Inc (REIT) | Citibank | 2.502 |
| (300) | SanBio Co Ltd | Citibank | (26) | (146) | Sekisui House Inc (REIT) | HSBC | 972 |
| (300) | SanBio Co Ltd | JP Morgan | (58) | (161) | Sekisui House Inc (REIT) | JP Morgan | 1.119 |
| 300 | Sangetsu Corp | Citibank | (276) | 11.900 | Sekisui House Ltd | Citibank | (17.725) |
| 900 | Sangetsu Corp | JP Morgan | 518 | 6.900 | Sekisui House Ltd | HSBC | (9.949) |
| 2.300 | San-In Godo Bank Ltd | HSBC | (285) | (700) | Sekisui Jushi Corp | Citibank | 905 |
| 500 | San-In Godo Bank Ltd | JP Morgan | (62) | (500) | Sekisui Jushi Corp | HSBC | 919 |
| (3.000) | Sanki Engineering Co Ltd | Citibank | 1.677 | 2.900 | Sekisui Kasei Co Ltd | JP Morgan | (1.076) |
| (100) | Sanki Engineering Co Ltd | HSBC | 87 | (600) | Senko Group Holdings Co Ltd | HSBC | 170 |
| 2.100 | Sankyo Co Ltd | Citibank | (5.229) | (1.300) | Senko Group Holdings Co Ltd | JP Morgan | 363 |
| 1.200 | Sankyo Co Ltd | HSBC | (4.554) | (21.800) | Senshu Ikeda Holdings Inc | JP Morgan | 2.983 |
| 400 | Sankyo Co Ltd | JP Morgan | (1.516) | (10.200) | Septeni Holdings Co Ltd | Citibank | 95 |
| 2.200 | Sankyu Inc | Citibank | (5.559) | (17.500) | Septeni Holdings Co Ltd | JP Morgan | 298 |
| 800 | Sankyu Inc | HSBC | (1.797) | 200 | Seria Co Ltd | HSBC | (380) |
| 1.700 | Sankyu Inc | JP Morgan | (3.812) | 3.300 | Seria Co Ltd | JP Morgan | (6.273) |
| 500 | Sanrio Co Ltd | Citibank | (2.295) | (1.700) | SG Holdings Co Ltd | Citibank | 1.959 |
| 500 | Sanrio Co Ltd | JP Morgan | (2.705) | (7.000) | SG Holdings Co Ltd | HSBC | 6.593 |
| 900 | Sansan Inc | Citibank | (116) | (1.400) | SG Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.596 |
| 700 | Sansan Inc | HSBC | (357) | | | | |
| 200 | Sansan Inc | JP Morgan | (171) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|-------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (700) | Sharp Corp | Citibank | 392 | (200) | Shochiku Co Ltd | HSBC | 1.442 |
| (3.800) | Sharp Corp | HSBC | 1.779 | (300) | Shochiku Co Ltd | JP Morgan | 2.160 |
| (11.300) | Sharp Corp | JP Morgan | 17.933 | 700 | Shoei Co Ltd | HSBC | (123) |
| 600 | Shibaura Electronics Co Ltd | Citibank | 183 | 500 | Shoei Co Ltd | JP Morgan | (119) |
| 100 | Shibaura Machine Co Ltd | Citibank | 140 | (700) | Shoei Foods Corp | Citibank | 763 |
| 200 | Shibaura Machine Co Ltd | JP Morgan | (279) | (600) | Shoei Foods Corp | JP Morgan | 880 |
| 100 | Shibaura Mechatronics Corp | Citibank | 1.800 | 300 | Showa Sangyo Co Ltd | Citibank | (36) |
| 300 | Shibaura Mechatronics Corp | JP Morgan | 2.948 | 200 | Showa Sangyo Co Ltd | HSBC | (297) |
| 100 | Shibuya Corp | Citibank | (107) | 8.800 | SIGMAXYZ Holdings Inc | Citibank | (9.250) |
| 500 | Shibuya Corp | HSBC | (744) | 400 | SIGMAXYZ Holdings Inc | HSBC | (168) |
| 100 | Shibuya Corp | JP Morgan | (149) | 6.000 | SIGMAXYZ Holdings Inc | JP Morgan | (1.337) |
| (100) | SHIFT Inc | HSBC | 217 | (14.600) | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | Citibank | 3.352 |
| (2.600) | Shiga Bank Ltd | HSBC | 3.222 | (6.800) | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | JP Morgan | 3.105 |
| (1.300) | Shiga Bank Ltd | JP Morgan | 719 | (4.400) | Skylark Holdings Co Ltd | Citibank | 1.742 |
| (3.000) | Shikoku Electric Power Co Inc | JP Morgan | (230) | (4.800) | Skylark Holdings Co Ltd | HSBC | 2.722 |
| (100) | Shikoku Kasei Holdings Corp | Citibank | 24 | (1.200) | Skylark Holdings Co Ltd | JP Morgan | 679 |
| (1.400) | Shikoku Kasei Holdings Corp | HSBC | 400 | (500) | SMC Corp | HSBC | (7.369) |
| (5.300) | Shikoku Kasei Holdings Corp | JP Morgan | 1.232 | 800 | SMS Co Ltd | HSBC | (675) |
| (100) | Shima Seiki Manufacturing Ltd | HSBC | 60 | 2.200 | SMS Co Ltd | JP Morgan | (3.704) |
| 1.600 | Shimadzu Corp | Citibank | (2.573) | 1.700 | Sodick Co Ltd | Citibank | (455) |
| 2.300 | Shimadzu Corp | JP Morgan | (1.658) | 3.300 | Sodick Co Ltd | HSBC | (2.037) |
| 200 | Shimamura Co Ltd | HSBC | (645) | 14.500 | Sodick Co Ltd | JP Morgan | (7.760) |
| 500 | Shimamura Co Ltd | JP Morgan | (977) | 2.500 | SoftBank Group Corp | HSBC | 2.754 |
| (100) | Shimano Inc | Citibank | 340 | 800 | SoftBank Group Corp | JP Morgan | 885 |
| (8.300) | Shimizu Corp | Citibank | 2.953 | 2.000 | Sohgo Security Services Co Ltd | JP Morgan | (486) |
| (7.700) | Shimizu Corp | HSBC | 661 | (3.500) | Sojitz Corp | HSBC | 3.513 |
| (21.700) | Shimizu Corp | JP Morgan | 2.287 | (1.800) | Sojitz Corp | JP Morgan | 1.803 |
| 4.100 | Shin Nippon Air Technologies Co Ltd | HSBC | 3.613 | 5.600 | Solasto Corp | Citibank | (1.143) |
| 2.100 | Shin Nippon Air Technologies Co Ltd | JP Morgan | 1.854 | 2.500 | Solasto Corp | JP Morgan | (1.094) |
| (3.100) | Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd | HSBC | 6.801 | 5.700 | Sompo Holdings Inc | Citibank | (17.301) |
| 2.000 | Shindengen Electric Manufacturing Co Ltd | Citibank | (2.523) | 1.500 | Sompo Holdings Inc | HSBC | (2.275) |
| 200 | Shindengen Electric Manufacturing Co Ltd | HSBC | (560) | 1.400 | Sompo Holdings Inc | JP Morgan | (2.117) |
| 700 | Shindengen Electric Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | (1.957) | (100) | Sony Group Corp | Citibank | 191 |
| 1.900 | Shin-Etsu Polymer Co Ltd | Citibank | (535) | (800) | Sony Group Corp | HSBC | (1.891) |
| 5.200 | Shin-Etsu Polymer Co Ltd | JP Morgan | (1.031) | (500) | Sony Group Corp | JP Morgan | (1.187) |
| (1.000) | Shinko Electric Industries Co Ltd | Citibank | (1.541) | (4.600) | Sotetsu Holdings Inc | HSBC | 7.989 |
| (1.100) | Shinko Electric Industries Co Ltd | HSBC | (6.909) | (1.800) | Sotetsu Holdings Inc | JP Morgan | 3.122 |
| (2.400) | Shinko Electric Industries Co Ltd | JP Morgan | (14.293) | (8.600) | Sourcenext Corp | JP Morgan | 2.772 |
| (1.900) | Shinmaywa Industries Ltd | Citibank | 722 | (900) | Sparx Group Co Ltd | Citibank | 575 |
| 2.200 | Shionogi & Co Ltd | Citibank | (2.875) | (2.400) | Sparx Group Co Ltd | HSBC | 1.787 |
| 2.100 | Shionogi & Co Ltd | HSBC | (1.778) | (3.500) | Sparx Group Co Ltd | JP Morgan | 2.601 |
| 1.000 | Shionogi & Co Ltd | JP Morgan | (1.193) | (200) | Square Enix Holdings Co Ltd | JP Morgan | 463 |
| 200 | Ship Healthcare Holdings Inc | Citibank | (96) | 4.000 | Stanley Electric Co Ltd | Citibank | (5.155) |
| 700 | Ship Healthcare Holdings Inc | HSBC | (728) | 600 | Stanley Electric Co Ltd | HSBC | (658) |
| 1.000 | Ship Healthcare Holdings Inc | JP Morgan | (1.038) | 1.600 | Stanley Electric Co Ltd | JP Morgan | (764) |
| 800 | Shiseido Co Ltd | Citibank | (4.018) | 400 | Star Micronics Co Ltd | Citibank | (305) |
| 1.500 | Shiseido Co Ltd | HSBC | (6.696) | 1.500 | Star Micronics Co Ltd | JP Morgan | (412) |
| 1.900 | Shiseido Co Ltd | JP Morgan | (4.922) | 2.600 | Starts Corp Inc | Citibank | (528) |
| (2.700) | Shizuoka Financial Group Inc | JP Morgan | 352 | 2.400 | Starts Corp Inc | HSBC | 280 |
| (600) | SHO-BOND Holdings Co Ltd | HSBC | 1.532 | 1.300 | Starts Corp Inc | JP Morgan | 188 |
| (300) | Shochiku Co Ltd | Citibank | 1.599 | (6) | Starts Proceed Investment Corp (REIT) | Citibank | (16) |
| | | | | (1) | Starts Proceed Investment Corp (REIT) | HSBC | 48 |
| | | | | (300) | StemRIM Inc | Citibank | 276 |
| | | | | (2.900) | StemRIM Inc | JP Morgan | 6.118 |
| | | | | 400 | Strike Co Ltd | Citibank | (1.153) |
| | | | | 600 | Strike Co Ltd | JP Morgan | (822) |
| | | | | 3.700 | Subaru Corp | Citibank | 355 |
| | | | | 1.100 | Sugi Holdings Co Ltd | Citibank | (3.200) |
| | | | | 4.600 | Sugi Holdings Co Ltd | HSBC | (9.134) |
| | | | | 2.100 | Sugi Holdings Co Ltd | JP Morgan | (3.047) |
| | | | | 1.500 | SUMCO Corp | Citibank | 141 |
| | | | | 500 | SUMCO Corp | HSBC | 33 |
| | | | | 2.900 | SUMCO Corp | JP Morgan | 197 |
| | | | | (400) | Sumitomo Bakelite Co Ltd | Citibank | 90 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------------|-------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (600) | Sumitomo Bakelite Co Ltd | JP Morgan | (550) | (1.000) | T Hasegawa Co Ltd | HSBC | 2.845 |
| 1.400 | Sumitomo Corp | Citibank | (237) | (1.500) | T Hasegawa Co Ltd | JP Morgan | 4.263 |
| 1.300 | Sumitomo Corp | JP Morgan | 553 | 3.700 | T&D Holdings Inc | Citibank | (1.894) |
| (300) | Sumitomo Densetsu Co Ltd | HSBC | 575 | (300) | Tadano Ltd | Citibank | 187 |
| (400) | Sumitomo Densetsu Co Ltd | JP Morgan | 850 | (5.800) | Tadano Ltd | HSBC | 2.484 |
| (2.500) | Sumitomo Electric Industries Ltd | Citibank | 1.731 | (5.900) | Tadano Ltd | JP Morgan | 2.522 |
| (12.500) | Sumitomo Electric Industries Ltd | JP Morgan | 13.268 | (300) | Taihei Dengyo Kaisha Ltd | Citibank | 426 |
| (3.900) | Sumitomo Forestry Co Ltd | Citibank | 2.042 | (600) | Taihei Dengyo Kaisha Ltd | HSBC | 1.590 |
| (5.800) | Sumitomo Forestry Co Ltd | HSBC | (4.877) | (600) | Taihei Dengyo Kaisha Ltd | JP Morgan | 1.066 |
| (800) | Sumitomo Heavy Industries Ltd | Citibank | 996 | 100 | Taiheiy Cement Corp | HSBC | (84) |
| (3.200) | Sumitomo Heavy Industries Ltd | HSBC | 6.697 | 1.000 | Taiheiy Cement Corp | JP Morgan | (835) |
| (100) | Sumitomo Heavy Industries Ltd | JP Morgan | 209 | 800 | Taikisha Ltd | Citibank | (1.393) |
| (1.000) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | Citibank | 1.786 | 1.400 | Taikisha Ltd | JP Morgan | (3.019) |
| (2.300) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | HSBC | 14.019 | (1.600) | Taisei Corp | Citibank | 3.698 |
| (2.400) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | JP Morgan | 17.170 | (3.900) | Taisei Corp | HSBC | 13.884 |
| 1.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | HSBC | (735) | (400) | Taisei Corp | JP Morgan | 1.335 |
| 2.500 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | JP Morgan | (1.825) | 1.400 | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | Citibank | (4.935) |
| 1.400 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Citibank | (3.630) | 1.800 | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | JP Morgan | (12.607) |
| 2.200 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | HSBC | (3.779) | (1.100) | Taiyo Yuden Co Ltd | Citibank | (1.021) |
| 400 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | JP Morgan | (499) | (1.800) | Taiyo Yuden Co Ltd | HSBC | 419 |
| 500 | Sumitomo Osaka Cement Co Ltd | Citibank | (354) | (2.900) | Taiyo Yuden Co Ltd | JP Morgan | 243 |
| 8.400 | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | Citibank | 3.907 | 600 | Takamatsu Construction Group Co Ltd | Citibank | (318) |
| 500 | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | JP Morgan | 524 | (1.700) | Takara Bio Inc | Citibank | 345 |
| (2.900) | Sumitomo Riko Co Ltd | Citibank | 916 | (4.400) | Takara Bio Inc | HSBC | 4.505 |
| (3.600) | Sumitomo Riko Co Ltd | HSBC | 147 | (2.200) | Takara Bio Inc | JP Morgan | 2.032 |
| (2.200) | Sumitomo Riko Co Ltd | JP Morgan | 88 | 100 | Takasago International Corp | HSBC | (106) |
| (8.200) | Sumitomo Rubber Industries Ltd | Citibank | 6.272 | 400 | Takasago International Corp | JP Morgan | (446) |
| (9.700) | Sumitomo Rubber Industries Ltd | HSBC | 4.917 | 600 | Takasago Thermal Engineering Co Ltd | Citibank | (573) |
| (13.100) | Sumitomo Rubber Industries Ltd | JP Morgan | 6.458 | 600 | Takasago Thermal Engineering Co Ltd | JP Morgan | (559) |
| 800 | Sumitomo Warehouse Co Ltd | Citibank | (716) | 10.000 | Takashimaya Co Ltd | HSBC | (12.945) |
| 400 | Sun Frontier Fudousan Co Ltd | HSBC | (24) | 3.100 | Takashimaya Co Ltd | JP Morgan | (4.377) |
| 2.600 | Sundrug Co Ltd | Citibank | (8.598) | (600) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 1.504 |
| 2.300 | Sundrug Co Ltd | HSBC | 1.199 | 3.500 | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | Citibank | (3.869) |
| (200) | Suntory Beverage & Food Ltd | Citibank | 660 | 100 | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | HSBC | (105) |
| (2.200) | Suntory Beverage & Food Ltd | HSBC | 2.310 | 3.300 | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | (2.870) |
| (100) | Suntory Beverage & Food Ltd | JP Morgan | 266 | 10.600 | Takuma Co Ltd | Citibank | (4.199) |
| (37.900) | Suruga Bank Ltd | Citibank | 3.174 | 21.000 | Takuma Co Ltd | JP Morgan | (9.419) |
| (13.200) | Suruga Bank Ltd | HSBC | 2.390 | 1.400 | Tamron Co Ltd | Citibank | (3.015) |
| (900) | Suruga Bank Ltd | JP Morgan | 163 | 2.800 | Tamron Co Ltd | HSBC | (3.322) |
| 1.300 | Suzuken Co Ltd | Citibank | (2.905) | 500 | Tamron Co Ltd | JP Morgan | (570) |
| 2.600 | Suzuki Motor Corp | HSBC | (7.200) | (6.000) | Tamura Corp | Citibank | 1.937 |
| (100) | Systemex Corp | HSBC | 218 | (19.600) | Tamura Corp | HSBC | 18.763 |
| (300) | Systemex Corp | JP Morgan | 652 | (14.200) | Tamura Corp | JP Morgan | 13.585 |
| 68.800 | Systema Corp | Citibank | (6.502) | (1.800) | TBS Holdings Inc | Citibank | (96) |
| 11.100 | Systema Corp | HSBC | 377 | (700) | TBS Holdings Inc | HSBC | (335) |
| 27.000 | Systema Corp | JP Morgan | 922 | (2.700) | TDK Corp | Citibank | 168 |
| | | | | (1.300) | TDK Corp | HSBC | (2.365) |
| | | | | (900) | TDK Corp | JP Morgan | 76 |
| | | | | 1.600 | TechMatrix Corp | HSBC | 25 |
| | | | | 2.200 | TechMatrix Corp | JP Morgan | (972) |
| | | | | 300 | TechnoPro Holdings Inc | Citibank | (806) |
| | | | | 600 | TechnoPro Holdings Inc | JP Morgan | (1.686) |
| | | | | (5.100) | Teijin Ltd | Citibank | 6.490 |
| | | | | (2.000) | Teijin Ltd | HSBC | 4.087 |
| | | | | (22.100) | Teijin Ltd | JP Morgan | 45.136 |
| | | | | 300 | Tenma Corp | Citibank | (145) |
| | | | | 600 | Tenma Corp | HSBC | (282) |
| | | | | 1.900 | Terumo Corp | Citibank | (874) |
| | | | | (700) | Tess Holdings Co Ltd | Citibank | 597 |
| | | | | (1.100) | Tess Holdings Co Ltd | HSBC | 2.036 |
| | | | | (4.000) | T-Gaia Corp | Citibank | 2.565 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------------|-------------|---|--------------------------|-------------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (8.000) | T-Gaia Corp | HSBC | 3.752 | (1.000) | Tokyo Gas Co Ltd | HSBC | 291 |
| (10.800) | T-Gaia Corp | JP Morgan | 5.050 | (2.400) | Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc | HSBC | (2.999) |
| 500 | THK Co Ltd | Citibank | (718) | 500 | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd | HSBC | 2.920 |
| 700 | TIS Inc | JP Morgan | (607) | 700 | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 4.093 |
| 300 | TKP Corp | Citibank | (340) | 500 | Tokyo Seimitsu Co Ltd | Citibank | 1.630 |
| 1.000 | TKP Corp | JP Morgan | (422) | 1.200 | Tokyo Seimitsu Co Ltd | JP Morgan | (988) |
| (600) | Toa Corp | Citibank | 308 | 500 | Tokyo Tatemono Co Ltd | HSBC | (44) |
| (4.500) | Toa Corp | JP Morgan | 1.643 | 15.100 | Tokyo Tatemono Co Ltd | JP Morgan | (5.000) |
| (1.200) | Toagosei Co Ltd | Citibank | 574 | 1.500 | Tokyotokeiba Co Ltd | Citibank | (3.221) |
| (8.500) | Toagosei Co Ltd | HSBC | 3.673 | 1.200 | Tokyotokeiba Co Ltd | JP Morgan | (2.666) |
| (1.900) | Toagosei Co Ltd | JP Morgan | 819 | 2.200 | Tokyu Construction Co Ltd | HSBC | (567) |
| (2.500) | Tobu Railway Co Ltd | Citibank | 3.547 | 3.300 | Tokyu Construction Co Ltd | JP Morgan | (1.196) |
| (200) | Tobu Railway Co Ltd | HSBC | 11 | (6.900) | Tokyu Corp | Citibank | 9.806 |
| (2.300) | Tobu Railway Co Ltd | JP Morgan | 123 | (5.500) | Tokyu Corp | HSBC | 8.765 |
| 1.800 | TOC Co Ltd | Citibank | (769) | (15.200) | Tokyu Corp | JP Morgan | 24.198 |
| 700 | TOC Co Ltd | JP Morgan | (433) | 25.900 | Tokyu Fudosan Holdings Corp | Citibank | (4.198) |
| (1.000) | Tocalo Co Ltd | Citibank | 201 | 23.400 | Tokyu Fudosan Holdings Corp | JP Morgan | 6.770 |
| (1.500) | Tocalo Co Ltd | HSBC | 277 | (51.600) | TOMONY Holdings Inc | JP Morgan | 7.841 |
| (1.200) | Tocalo Co Ltd | JP Morgan | 249 | 1.200 | Tonami Holdings Co Ltd | Citibank | (2.652) |
| (19.100) | Toda Corp | Citibank | 7.735 | 200 | Tonami Holdings Co Ltd | HSBC | (828) |
| (9.200) | Toda Corp | HSBC | 5.126 | 300 | Tonami Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.241) |
| (6.100) | Toda Corp | JP Morgan | 3.394 | 900 | Topcon Corp | Citibank | 417 |
| 200 | Toei Animation Co Ltd | JP Morgan | (1.079) | 1.600 | Topcon Corp | JP Morgan | (1.008) |
| (100) | Toei Co Ltd | JP Morgan | 820 | (4.200) | TOPPAN Inc | Citibank | 2.330 |
| (300) | Toenec Corp | Citibank | 647 | (2.900) | Topre Corp | HSBC | 1.265 |
| (74.200) | Toho Bank Ltd | Citibank | 1.991 | (100) | Topre Corp | JP Morgan | 27 |
| (11.500) | Toho Bank Ltd | HSBC | 825 | (1.400) | Torii Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 1.533 |
| (116.900) | Toho Bank Ltd | JP Morgan | 7.036 | (2.300) | Torii Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 800 |
| (1.100) | Toho Co Ltd | Citibank | 2.482 | 1.700 | Tosei Corp | Citibank | (353) |
| (400) | Toho Co Ltd | HSBC | 406 | 2.700 | Tosei Corp | JP Morgan | (754) |
| (3.600) | Toho Co Ltd | JP Morgan | 3.641 | (1.800) | Toshiba TEC Corp | HSBC | (1.614) |
| 800 | Toho Gas Co Ltd | Citibank | (1.123) | 1.700 | Tosho Co Ltd | Citibank | (1.358) |
| 600 | Toho Gas Co Ltd | HSBC | (267) | 2.800 | Tosho Co Ltd | JP Morgan | (5.464) |
| 1.800 | Toho Gas Co Ltd | JP Morgan | (2.038) | 200 | Tosoh Corp | Citibank | (97) |
| (500) | Toho Titanium Co Ltd | Citibank | 205 | (200) | Totetsu Kogyo Co Ltd | Citibank | 282 |
| (800) | Toho Titanium Co Ltd | JP Morgan | 1.100 | (100) | Totetsu Kogyo Co Ltd | HSBC | 220 |
| (6.000) | Tohoku Electric Power Co Inc | Citibank | (2.314) | (1.000) | Totetsu Kogyo Co Ltd | JP Morgan | 2.198 |
| (4.000) | Tohoku Electric Power Co Inc | HSBC | (1.058) | 100 | TOTO Ltd | Citibank | (72) |
| (1.500) | Tohoku Electric Power Co Inc | JP Morgan | (68) | (1.000) | Towa Corp | Citibank | (373) |
| 1.900 | Tokai Corp | Citibank | (2.326) | (2.700) | Towa Corp | HSBC | (5.174) |
| 2.400 | Tokai Corp | JP Morgan | (4.406) | (2.600) | Towa Corp | JP Morgan | (4.604) |
| (5.700) | TOKAI Holdings Corp | Citibank | 1.217 | (3.600) | Towa Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 4.939 |
| (3.100) | TOKAI Holdings Corp | HSBC | 1.053 | (6.200) | Towa Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 11.281 |
| (2.100) | TOKAI Holdings Corp | JP Morgan | 712 | (8.100) | Towa Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 15.251 |
| (2.200) | Tokai Rika Co Ltd | HSBC | 105 | (11.100) | Toyo Construction Co Ltd | JP Morgan | 2.389 |
| (4.300) | Tokai Rika Co Ltd | JP Morgan | 199 | 200 | Toyo Gosei Co Ltd | Citibank | 268 |
| (116.500) | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | Citibank | 15.894 | 200 | Toyo Gosei Co Ltd | HSBC | 1.215 |
| (58.000) | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | HSBC | 7.825 | (4.100) | Toyo Seikan Group Holdings Ltd | Citibank | 1.341 |
| (22.300) | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | JP Morgan | 3.002 | (4.500) | Toyo Seikan Group Holdings Ltd | HSBC | (1.832) |
| 4.500 | Tokio Marine Holdings Inc | HSBC | 10.208 | (800) | Toyo Seikan Group Holdings Ltd | JP Morgan | (170) |
| 600 | Tokio Marine Holdings Inc | JP Morgan | 1.362 | 1.700 | Toyo Tanso Co Ltd | Citibank | (479) |
| (2.500) | Tokuyama Corp | Citibank | 1.610 | 1.400 | Toyo Tanso Co Ltd | JP Morgan | 3.454 |
| (2.900) | Tokuyama Corp | HSBC | 2.523 | (1.000) | Toyo Tire Corp | HSBC | (90) |
| (400) | Tokuyama Corp | JP Morgan | 347 | (500) | Toyo Tire Corp | JP Morgan | (45) |
| 200 | Tokyo Century Corp | JP Morgan | (117) | (500) | Toyobo Co Ltd | Citibank | 200 |
| (14.900) | Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | HSBC | 2.887 | (3.700) | Toyobo Co Ltd | HSBC | 2.948 |
| (14.500) | Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | JP Morgan | 2.804 | (1.100) | Toyobo Co Ltd | JP Morgan | 876 |
| (700) | Tokyo Electron Device Ltd | Citibank | (4.638) | (1.200) | Toyoda Gosei Co Ltd | Citibank | 984 |
| (100) | Tokyo Electron Device Ltd | HSBC | (1.207) | (300) | Toyoda Gosei Co Ltd | HSBC | 149 |
| (500) | Tokyo Electron Device Ltd | JP Morgan | (4.943) | (2.100) | Toyoda Gosei Co Ltd | JP Morgan | 1.001 |
| 300 | Tokyo Electron Ltd | Citibank | 728 | (1.800) | Toyota Boshoku Corp | Citibank | 525 |
| (2.400) | Tokyo Gas Co Ltd | Citibank | 1.310 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-------------------------------------|-------------|---|--------------------------|-------------------------------|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.900) | Toyota Boshoku Corp | HSBC | (1.186) | (2.000) | V-Cube Inc | Citibank | (156) |
| (10.300) | Toyota Boshoku Corp | JP Morgan | (6.449) | (200) | V-Cube Inc | JP Morgan | 68 |
| 800 | Toyota Industries Corp | Citibank | 969 | 9.500 | Vector Inc | JP Morgan | (2.277) |
| 2.300 | Toyota Industries Corp | HSBC | 8.270 | 200 | Vision Inc | Citibank | (49) |
| 2.700 | Toyota Motor Corp | Citibank | (1.433) | 1.800 | Vision Inc | HSBC | 417 |
| 11.600 | Toyota Motor Corp | HSBC | (3.635) | 1.400 | Vision Inc | JP Morgan | 184 |
| (900) | Toyota Tsusho Corp | HSBC | 666 | 16.200 | VT Holdings Co Ltd | Citibank | (1.451) |
| (800) | Transcosmos Inc | Citibank | 723 | 1.000 | Wacoal Holdings Corp | Citibank | (929) |
| (500) | Transcosmos Inc | HSBC | 481 | 100 | Wacoal Holdings Corp | HSBC | 56 |
| (1.700) | Transcosmos Inc | JP Morgan | 1.370 | 2.200 | Wacoal Holdings Corp | JP Morgan | 1.026 |
| 500 | TRE Holdings Corp | Citibank | (329) | (14.800) | Wacom Co Ltd | Citibank | 5.332 |
| 500 | TRE Holdings Corp | HSBC | (692) | (13.900) | Wacom Co Ltd | HSBC | 5.823 |
| (200) | Trend Micro Inc | JP Morgan | 281 | (23.900) | Wacom Co Ltd | JP Morgan | 9.914 |
| 200 | Tri Chemical Laboratories Inc | | | 600 | WDB Holdings Co Ltd | Citibank | (548) |
| | | HSBC | 169 | 1.400 | WDB Holdings Co Ltd | HSBC | (497) |
| 6.500 | Tri Chemical Laboratories Inc | | | 700 | WDB Holdings Co Ltd | JP Morgan | (350) |
| | | JP Morgan | 5.494 | (700) | Weathernews Inc | Citibank | 2.543 |
| 1.400 | Trusco Nakayama Corp | Citibank | (2.691) | (100) | Weathernews Inc | HSBC | 365 |
| 1.400 | Trusco Nakayama Corp | HSBC | (2.756) | (400) | Weathernews Inc | JP Morgan | 1.410 |
| 3.300 | Trusco Nakayama Corp | JP Morgan | (6.489) | (900) | Welcia Holdings Co Ltd | Citibank | 698 |
| (2.200) | TS Tech Co Ltd | HSBC | 2.039 | (1.500) | West Japan Railway Co | Citibank | 5.200 |
| 2.800 | Tsubaki Nakashima Co Ltd | Citibank | (2.295) | (2.200) | West Japan Railway Co | HSBC | 6.854 |
| 3.200 | Tsubaki Nakashima Co Ltd | HSBC | (4.288) | (2.700) | West Japan Railway Co | JP Morgan | 8.399 |
| 2.100 | Tsubakimoto Chain Co | Citibank | (1.939) | 400 | WingArc1st Inc | HSBC | 277 |
| 3.600 | Tsubakimoto Chain Co | HSBC | (8.667) | (1.400) | Workman Co Ltd | JP Morgan | 5.628 |
| 1.000 | Tsubakimoto Chain Co | JP Morgan | (2.516) | 100 | Workman Co Ltd | JP Morgan | (402) |
| (1.000) | Tsuburaya Fields Holdings Inc | | | (5.500) | W-Scope Corp | Citibank | 3.918 |
| | | Citibank | 2.693 | (500) | W-Scope Corp | HSBC | 653 |
| (800) | Tsuburaya Fields Holdings Inc | | | 8.800 | Xebio Holdings Co Ltd | JP Morgan | (8.348) |
| | | HSBC | (1.457) | 500 | Yakult Honsha Co Ltd | Citibank | (1.940) |
| 2.200 | Tsugami Corp | Citibank | (1.017) | (2.300) | YAMABIKO Corp | Citibank | 1.528 |
| 3.000 | Tsugami Corp | HSBC | (3.722) | (1.800) | YAMABIKO Corp | HSBC | (152) |
| 2.800 | Tsugami Corp | JP Morgan | (3.471) | (9.500) | YAMABIKO Corp | JP Morgan | (815) |
| 600 | Tsumura & Co | HSBC | (499) | 13.600 | Yamaguchi Financial Group Inc | | |
| 1.000 | Tsumura & Co | JP Morgan | (829) | | | Citibank | (13) |
| 400 | Tsuruha Holdings Inc | Citibank | (2.089) | 200 | Yamaguchi Financial Group Inc | | |
| 1.300 | Tsuruha Holdings Inc | JP Morgan | 1.615 | | | HSBC | 74 |
| (8.000) | TV Asahi Holdings Corp | Citibank | 4.766 | 1.500 | Yamaguchi Financial Group Inc | | |
| (1.100) | TV Asahi Holdings Corp | HSBC | 193 | | | JP Morgan | 553 |
| (6.800) | TV Asahi Holdings Corp | JP Morgan | 4.777 | 1.000 | Yamaha Corp | HSBC | (80) |
| (1.000) | UACJ Corp | Citibank | 997 | 800 | Yamaha Corp | JP Morgan | (166) |
| (500) | UACJ Corp | HSBC | 936 | 5.000 | Yamaha Motor Co Ltd | HSBC | (5.639) |
| (200) | UACJ Corp | JP Morgan | 374 | 3.600 | Yamaha Motor Co Ltd | JP Morgan | (2.556) |
| 1.500 | UBE Corp | Citibank | 362 | 2.200 | Yamaichi Electronics Co Ltd | Citibank | 1.361 |
| 200 | Uchida Yoko Co Ltd | Citibank | (586) | (300) | YA-MAN Ltd | HSBC | 23 |
| 100 | Uchida Yoko Co Ltd | JP Morgan | (326) | (800) | YA-MAN Ltd | JP Morgan | 149 |
| 300 | Ulvac Inc | HSBC | 36 | (400) | Yamato Holdings Co Ltd | Citibank | (53) |
| 1.100 | Unicharm Corp | HSBC | (3.321) | (400) | Yamato Holdings Co Ltd | HSBC | (33) |
| 8.300 | United Arrows Ltd | Citibank | (4.707) | (400) | Yamato Holdings Co Ltd | JP Morgan | (16) |
| 2.200 | United Arrows Ltd | HSBC | 3.598 | 400 | Yamato Kogyo Co Ltd | Citibank | (437) |
| 6.400 | United Arrows Ltd | JP Morgan | 13.722 | 200 | Yamato Kogyo Co Ltd | HSBC | (305) |
| 8 | United Urban Investment Corp (REIT) | | | 1.300 | Yamato Kogyo Co Ltd | JP Morgan | (1.978) |
| | | JP Morgan | (520) | 1.000 | Yamazaki Baking Co Ltd | Citibank | (619) |
| 800 | Universal Entertainment Corp | | | 1.300 | Yamazaki Baking Co Ltd | HSBC | (503) |
| | | JP Morgan | (3.299) | 1.800 | Yamazaki Baking Co Ltd | JP Morgan | (701) |
| 5.500 | Usen-Next Holdings Co Ltd | Citibank | (957) | 11.200 | Yamazen Corp | Citibank | (5.680) |
| 1.100 | Usen-Next Holdings Co Ltd | JP Morgan | 887 | 4.500 | Yamazen Corp | HSBC | (2.483) |
| (2.000) | Ushio Inc | HSBC | (1.327) | 17.000 | Yamazen Corp | JP Morgan | (9.365) |
| (2.800) | Ushio Inc | JP Morgan | (1.871) | 200 | Yaoko Co Ltd | Citibank | (617) |
| (2.400) | USS Co Ltd | Citibank | 2.100 | 1.000 | Yaoko Co Ltd | HSBC | (1.706) |
| (3.500) | USS Co Ltd | HSBC | 2.898 | 500 | Yaoko Co Ltd | JP Morgan | (1.857) |
| (1.800) | USS Co Ltd | JP Morgan | 869 | (400) | Yaskawa Electric Corp | Citibank | 110 |
| 1.000 | UT Group Co Ltd | Citibank | (716) | (1.500) | Yaskawa Electric Corp | HSBC | (529) |
| 1.200 | UT Group Co Ltd | JP Morgan | 559 | (2.700) | Yaskawa Electric Corp | JP Morgan | (964) |
| 1.100 | Valqua Ltd | Citibank | 495 | (500) | Yellow Hat Ltd | Citibank | 310 |
| 200 | Valqua Ltd | HSBC | (268) | 2.700 | Yodogawa Steel Works Ltd | Citibank | (1.462) |
| 300 | Valqua Ltd | JP Morgan | (350) | 3.200 | Yodogawa Steel Works Ltd | JP Morgan | (1.381) |
| 1.900 | ValueCommerce Co Ltd | Citibank | (183) | (3.200) | Yokohama Rubber Co Ltd | HSBC | 2.268 |
| 3.700 | ValueCommerce Co Ltd | HSBC | 442 | (3.300) | Yokohama Rubber Co Ltd | JP Morgan | 2.331 |
| 1.900 | ValueCommerce Co Ltd | JP Morgan | 229 | (4.100) | Yokorei Co Ltd | Citibank | 1.041 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Malaysia Fortsetzung | | | |
| (2.200) | Yokorei Co Ltd | HSBC | 944 | 18.200 | Hong Leong Bank Bhd | HSBC | (6.763) |
| (100) | Yokorei Co Ltd | JP Morgan | 47 | 3.000 | Hong Leong Bank Bhd | JP Morgan | (1.115) |
| (2.500) | Yonex Co Ltd | HSBC | 4.099 | 24.500 | IJM Corp Bhd | JP Morgan | (19) |
| (1.500) | Yoshinoya Holdings Co Ltd | Citibank | 281 | (5.600) | Inari Amertron Bhd | Citibank | (338) |
| (500) | Yoshinoya Holdings Co Ltd | HSBC | 71 | (6.400) | Inari Amertron Bhd | JP Morgan | (105) |
| (3.500) | Yoshinoya Holdings Co Ltd | JP Morgan | 492 | (1.000) | IOI Corp Bhd | Citibank | 80 |
| 2.400 | Yuasa Trading Co Ltd | Citibank | (4.710) | (7.800) | IOI Corp Bhd | JP Morgan | 479 |
| 300 | Yuasa Trading Co Ltd | HSBC | (528) | 9.900 | Kossan Rubber Industries Bhd | Citibank | (45) |
| 700 | Yuasa Trading Co Ltd | JP Morgan | 375 | 11.200 | Kossan Rubber Industries Bhd | HSBC | 512 |
| 3.000 | Yurtec Corp | JP Morgan | (1.186) | 37.800 | Kossan Rubber Industries Bhd | JP Morgan | 1.727 |
| (2.600) | Z Holdings Corp | Citibank | 339 | 15.000 | Malaysia Airports Holdings Bhd | Citibank | (2.068) |
| (11.100) | Z Holdings Corp | HSBC | 1.801 | 9.800 | Malaysia Airports Holdings Bhd | HSBC | (1.341) |
| (9.100) | Z Holdings Corp | JP Morgan | 1.474 | 28.300 | Malaysia Airports Holdings Bhd | JP Morgan | (3.873) |
| 200 | Zenkoku Hoshou Co Ltd | Citibank | (301) | (2.600) | Malaysian Pacific Industries Bhd | JP Morgan | 612 |
| 400 | Zenkoku Hoshou Co Ltd | HSBC | (441) | (1.200) | Maxis Bhd | Citibank | 34 |
| 2.200 | Zenkoku Hoshou Co Ltd | JP Morgan | (2.919) | (7.000) | Maxis Bhd | JP Morgan | 661 |
| 2.500 | Zenrin Co Ltd | Citibank | (1.367) | 1.800 | MISC Bhd | Citibank | (72) |
| 700 | Zenrin Co Ltd | HSBC | (526) | 12.400 | MISC Bhd | HSBC | (957) |
| 1.500 | Zensho Holdings Co Ltd | JP Morgan | 1.234 | 27.100 | MISC Bhd | JP Morgan | (2.091) |
| (800) | Zeon Corp | Citibank | 470 | (31.800) | My EG Services Bhd | Citibank | (302) |
| (5.000) | Zeon Corp | HSBC | 316 | (186.100) | My EG Services Bhd | JP Morgan | (1.364) |
| (4.900) | Zeon Corp | JP Morgan | 619 | (3.600) | Nestle Malaysia Bhd | Citibank | 2.284 |
| (200) | ZERIA Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 325 | (200) | Nestle Malaysia Bhd | JP Morgan | 270 |
| (300) | ZERIA Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | 391 | (1.000) | Petronas Chemicals Group Bhd | Citibank | 108 |
| (200) | ZERIA Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 322 | (32.900) | Public Bank Bhd | HSBC | 2.576 |
| (400) | Zojirushi Corp | Citibank | 431 | 39.700 | RHB Bank Bhd | Citibank | (1.966) |
| (2.300) | Zojirushi Corp | HSBC | 2.915 | 43.200 | RHB Bank Bhd | HSBC | (4.156) |
| (2.600) | Zojirushi Corp | JP Morgan | 3.291 | 95.600 | RHB Bank Bhd | JP Morgan | (9.198) |
| 2.300 | ZOZO Inc | JP Morgan | (2.130) | 32.900 | TSH Resources Bhd | Citibank | (710) |
| 500 | Zuken Inc | Citibank | (337) | 300 | TSH Resources Bhd | HSBC | (7) |
| 800 | Zuken Inc | HSBC | (306) | 220.600 | TSH Resources Bhd | JP Morgan | (5.527) |
| 2.100 | Zuken Inc | JP Morgan | (797) | (38) | Veleso Energy Bhd ^{tr} | HSBC | — |
| | | | <u>154.330</u> | (75.200) | VS Industry Bhd | Citibank | 104 |
| | Malaysia | | | (131.800) | VS Industry Bhd | JP Morgan | 1.365 |
| (1) | AGMO HOLDINGS Bhd ^{tr} | Citibank | — | (10.600) | Yinson Holdings Bhd | JP Morgan | 145 |
| (17) | AGMO HOLDINGS Bhd ^{tr} | JP Morgan | — | 80.200 | YTL Corp Bhd | Citibank | 2.979 |
| 16.600 | ATA IMS Bhd | Citibank | 5 | 26.100 | YTL Corp Bhd | JP Morgan | 840 |
| 116.600 | ATA IMS Bhd | JP Morgan | (264) | | | | <u>(71.020)</u> |
| 99.100 | BerMaz Motor Sdn Bhd | Citibank | (448) | Neuseeland | | | |
| 6.600 | BerMaz Motor Sdn Bhd | HSBC | (244) | 154 | Auckland International Airport Ltd | HSBC | (26) |
| 50.700 | BerMaz Motor Sdn Bhd | JP Morgan | (1.873) | 63 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Citibank | (160) |
| 62.200 | Bumi Armada Bhd | JP Morgan | (1.040) | | | | <u>(186)</u> |
| (19.900) | Bursa Malaysia Bhd | JP Morgan | 945 | Philippinen | | | |
| (19.900) | CELCOMDIGI Bhd | Citibank | 13 | (23.610) | ACEN Corp | JP Morgan | 128 |
| (150.300) | CELCOMDIGI Bhd | JP Morgan | 3.485 | 5 | Altus Property Ventures Inc ^{tr} | HSBC | — |
| 6.300 | CIMB Group Holdings Bhd | Citibank | (412) | (7.870) | Ayala Corp | JP Morgan | 1.359 |
| 61.300 | CIMB Group Holdings Bhd | HSBC | (7.273) | (1.500) | Ayala Land Inc | HSBC | 28 |
| (24.700) | CTOS Digital Bhd | Citibank | 482 | (45.000) | Ayala Land Inc | JP Morgan | 814 |
| (175.500) | CTOS Digital Bhd | JP Morgan | 5.383 | 2.268 | BDO Unibank Inc | Citibank | (154) |
| (9.200) | D&O Green Technologies Bhd | Citibank | 427 | 7.080 | BDO Unibank Inc | HSBC | (408) |
| (37.200) | D&O Green Technologies Bhd | JP Morgan | 4.377 | 8.628 | BDO Unibank Inc | JP Morgan | (479) |
| 150.100 | Dayang Enterprise Holdings Bhd | Citibank | (7.141) | 9.020 | International Container Terminal Services Inc | Citibank | (1.155) |
| 190.400 | Dayang Enterprise Holdings Bhd | HSBC | (9.237) | 7.540 | International Container Terminal Services Inc | HSBC | (2.475) |
| 265.900 | Dayang Enterprise Holdings Bhd | JP Morgan | (12.899) | 5.030 | International Container Terminal Services Inc | JP Morgan | (1.634) |
| 17.400 | Gamuda Bhd | Citibank | 985 | (11.487) | JG Summit Holdings Inc | JP Morgan | 546 |
| 30.700 | Gamuda Bhd | JP Morgan | 1.164 | | | | |
| 7.200 | Heineken Malaysia Bhd | Citibank | (1.889) | | | | |
| 5.500 | Heineken Malaysia Bhd | HSBC | (3.999) | | | | |
| 19.000 | Heineken Malaysia Bhd | JP Morgan | (13.816) | | | | |
| 2.600 | Hong Leong Bank Bhd | Citibank | (510) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|--------------------------------|--|-------------|--|-----------------------------|--|-------------|--|
| Philippinen Fortsetzung | | | | Singapur Fortsetzung | | | |
| (33.160) | Metropolitan Bank & Trust Co | JP Morgan | 2.145 | 55.200 | Golden Agri-Resources Ltd | JP Morgan | (240) |
| 1.270 | SM Investments Corp | Citibank | (11) | (800) | Hongkong Land Holdings Ltd | Citibank | 128 |
| 720 | SM Investments Corp | HSBC | (77) | (10.100) | Hongkong Land Holdings Ltd | HSBC | 1.212 |
| (127.300) | SM Prime Holdings Inc | JP Morgan | 2.527 | (3.400) | Hongkong Land Holdings Ltd | JP Morgan | 408 |
| (1.010) | Universal Robina Corp | HSBC | 228 | 287.000 | Hutchison Port Holdings Trust (Unit) | Citibank | (287) |
| (10.610) | Universal Robina Corp | JP Morgan | 2.367 | (16.400) | iFAST Corp Ltd | Citibank | (941) |
| | | | 3.749 | (2.500) | iFAST Corp Ltd | JP Morgan | (74) |
| | | | | 488.800 | Keppel (REIT) | JP Morgan | (8.750) |
| (93.900) | AEM Holdings Ltd | Citibank | (27.713) | 79.700 | Keppel Corp Ltd | JP Morgan | (14.866) |
| (4.100) | AEM Holdings Ltd | HSBC | (42) | 276.045 | Keppel Infrastructure Trust (Unit) | Citibank | (636) |
| (165.200) | AEM Holdings Ltd | JP Morgan | (1.474) | 53.445 | Keppel Infrastructure Trust (Unit) | HSBC | (1.972) |
| 5.500 | AIMS APAC (REIT) | HSBC | (614) | 515.550 | Keppel Infrastructure Trust (Unit) | JP Morgan | (3.745) |
| 8.900 | AIMS APAC (REIT) | JP Morgan | (998) | (15.700) | Lendlease Global Commercial (REIT) | Citibank | 50 |
| 600 | Best World International Ltd | JP Morgan | (77) | (42.600) | Lendlease Global Commercial (REIT) | HSBC | 1.098 |
| (34.900) | CapitalLand Ascott Trust (Unit) | Citibank | 695 | (164.700) | Lendlease Global Commercial (REIT) | JP Morgan | 4.283 |
| (102.565) | CapitalLand Ascott Trust (Unit) | HSBC | (753) | 6.700 | Mapletree Industrial Trust (REIT) | JP Morgan | (755) |
| (172.639) | CapitalLand Ascott Trust (Unit) | JP Morgan | 5.608 | (131.700) | Mapletree Industrial Trust (REIT) | JP Morgan | 14.846 |
| (123.000) | CapitalLand China Trust (REIT) | Citibank | 5.156 | (72.900) | Mapletree Logistics Trust (REIT) | HSBC | 7.445 |
| (252.800) | CapitalLand China Trust (REIT) | JP Morgan | 25.142 | (86.200) | Mapletree Logistics Trust (REIT) | JP Morgan | 8.855 |
| 152.800 | Capitaland India Trust (Unit) | Citibank | 367 | (56.100) | Mapletree Pan Asia Commercial Trust (REIT) | HSBC | 5.720 |
| 41.600 | Capitaland India Trust (Unit) | JP Morgan | (1.037) | (47.200) | Mapletree Pan Asia Commercial Trust (REIT) | JP Morgan | 4.841 |
| 72.600 | CapitalLand Integrated Commercial Trust (REIT) | JP Morgan | (5.670) | (39.100) | Marco Polo Marine Ltd | JP Morgan | (57) |
| (105.000) | CapitalLand Investment Ltd | HSBC | 43.088 | (6.800) | Nanofilm Technologies International Ltd | Citibank | (155) |
| (67.100) | CapitalLand Investment Ltd | JP Morgan | 28.006 | (12.000) | Nanofilm Technologies International Ltd | JP Morgan | 1.286 |
| 15.600 | City Developments Ltd | HSBC | (4.176) | 131.100 | NETLINK NBN TRUST (Unit) | Citibank | (3.950) |
| 38.700 | City Developments Ltd | JP Morgan | (10.881) | 91.100 | NETLINK NBN TRUST (Unit) | HSBC | (3.672) |
| 146.200 | ComfortDelGro Corp Ltd | Citibank | (1.851) | 149.000 | NETLINK NBN TRUST (Unit) | JP Morgan | (5.144) |
| (22.200) | ComfortDelGro Corp Ltd | HSBC | 1.900 | 46.000 | Olam Group Ltd | Citibank | (2.704) |
| 28.300 | ComfortDelGro Corp Ltd | HSBC | (2.422) | 400 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | JP Morgan | (74) |
| 6.800 | DBS Group Holdings Ltd | JP Morgan | (11.850) | (49.500) | PARAGON (REIT) | Citibank | (516) |
| (7.800) | DFI Retail Group Holdings Ltd | Citibank | 2.106 | (1.900) | PARAGON (REIT) | HSBC | (9) |
| (12.400) | DFI Retail Group Holdings Ltd | JP Morgan | 1.337 | (87.000) | PARAGON (REIT) | JP Morgan | (466) |
| 38.700 | Dyna-Mac Holdings Ltd | Citibank | (485) | 1.900 | Parkway Life (REIT) | Citibank | (343) |
| 10.500 | Dyna-Mac Holdings Ltd | JP Morgan | (129) | 10.800 | Parkway Life (REIT) | HSBC | (3.312) |
| (1.900) | Eagle Hospitality Trust (Unit)* | Citibank | 260 | 13.200 | Parkway Life (REIT) | JP Morgan | (4.066) |
| (15.200) | Eagle Hospitality Trust (Unit)* | JP Morgan | 2.082 | 113.500 | Raffles Medical Group Ltd | Citibank | (4.920) |
| (20.036) | ESR-LOGOS (REIT) | HSBC | 106 | 9.800 | Raffles Medical Group Ltd | HSBC | (1.388) |
| (129.800) | ESR-LOGOS (REIT) | JP Morgan | 702 | 18.900 | Raffles Medical Group Ltd | JP Morgan | (2.686) |
| 43.300 | Far East Hospitality Trust (Unit) | Citibank | (444) | 9.600 | SATS Ltd | HSBC | (832) |
| 77.500 | Far East Hospitality Trust (Unit) | HSBC | (2.137) | 33.600 | SATS Ltd | JP Morgan | (2.944) |
| 130.200 | Far East Hospitality Trust (Unit) | JP Morgan | (3.785) | 1.485.220 | Seatrium Ltd | JP Morgan | (9.724) |
| (2.100) | First Resources Ltd | JP Morgan | 13 | (80.600) | SIA Engineering Co Ltd | Citibank | 5.697 |
| 16.400 | Frasers Centrepoint Trust (REIT) | Citibank | (1.141) | (39.100) | SIA Engineering Co Ltd | JP Morgan | (2.620) |
| 3.100 | Frasers Centrepoint Trust (REIT) | HSBC | (200) | 7.400 | Singapore Airlines Ltd | HSBC | 2.254 |
| 145.800 | Frasers Centrepoint Trust (REIT) | JP Morgan | (9.496) | 62.800 | Singapore Airlines Ltd | JP Morgan | 19.005 |
| (35.000) | Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT) | HSBC | 3.338 | (28.800) | Singapore Exchange Ltd | JP Morgan | 8.949 |
| (164.200) | Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT) | JP Morgan | 15.737 | (3.600) | Singapore Technologies Engineering Ltd | Citibank | 330 |
| 276.000 | Golden Agri-Resources Ltd | Citibank | 679 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Singapur Fortsetzung | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| (78.900) | Singapore Technologies Engineering Ltd | HSBC | 4.041 | (188) | CJ CheilJedang Corp | JP Morgan | 1.989 |
| (56.100) | Singapore Technologies Engineering Ltd | JP Morgan | 2.943 | 1.256 | CJ ENM Co Ltd | JP Morgan | (1.200) |
| 89.300 | Singapore Telecommunications Ltd | HSBC | (9.329) | 4.817 | CJ Logistics Corp | Citibank | (7.877) |
| 35.800 | Singapore Telecommunications Ltd | JP Morgan | (4.165) | 2.161 | CJ Logistics Corp | HSBC | 1.534 |
| 2.600 | StarHub Ltd | Citibank | 7 | 968 | CJ Logistics Corp | JP Morgan | (1.255) |
| 4.900 | StarHub Ltd | HSBC | (79) | (10.800) | Classys Inc | Citibank | (1.409) |
| (1.200) | Suntec (REIT) | Citibank | 34 | (483) | Classys Inc | JP Morgan | (832) |
| (40.800) | Suntec (REIT) | HSBC | 3.014 | 412 | CLIO Cosmetics Co Ltd | Citibank | (418) |
| (27.300) | Suntec (REIT) | JP Morgan | 2.029 | 1.365 | Connectwave Co Ltd | JP Morgan | (1.151) |
| 40.900 | Thai Beverage PCL | JP Morgan | (2.537) | 1.171 | Cosmax Inc | HSBC | 3.320 |
| (10.700) | UMS Holdings Ltd | Citibank | (620) | 1.555 | Cosmax Inc | JP Morgan | (146) |
| (24.100) | UMS Holdings Ltd | JP Morgan | (957) | (23) | Coway Co Ltd | Citibank | 26 |
| 100 | United Overseas Bank Ltd | HSBC | (80) | (1.634) | Coway Co Ltd | JP Morgan | 1.954 |
| (11.500) | UOL Group Ltd | HSBC | 6.033 | (11.703) | Creative & Innovative System | Citibank | 1.941 |
| (57.300) | UOL Group Ltd | JP Morgan | 30.195 | (209) | Creative & Innovative System | HSBC | 75 |
| (2.200) | Venture Corp Ltd | HSBC | 255 | (6.552) | Creative & Innovative System | JP Morgan | 2.366 |
| (15.200) | Venture Corp Ltd | JP Morgan | 8.743 | (5.191) | CS Wind Corp | Citibank | (2.211) |
| (40.800) | Wilmar International Ltd | HSBC | 3.177 | (796) | CS Wind Corp | JP Morgan | (3.449) |
| (16.500) | Wilmar International Ltd | JP Morgan | 1.307 | (564) | Daeduck Co Ltd | JP Morgan | — |
| (30.400) | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd | Citibank | 630 | (2.071) | Daejoo Electronic Materials Co Ltd | Citibank | (9.417) |
| (81.400) | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd | HSBC | 2.836 | (561) | Daejoo Electronic Materials Co Ltd | JP Morgan | 956 |
| (86.600) | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd | JP Morgan | 3.054 | 11.687 | Daesang Corp | Citibank | (6.802) |
| (71.700) | Yanlord Land Group Ltd | Citibank | 2.126 | 46.519 | Daewoo Engineering & Construction Co Ltd | Citibank | (4.562) |
| (191.600) | Yanlord Land Group Ltd | HSBC | 19.706 | (3.133) | Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd | Citibank | 1.601 |
| (90.000) | Yanlord Land Group Ltd | JP Morgan | 9.284 | (351) | Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd | HSBC | (750) |
| | | | 135.153 | (580) | Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd | JP Morgan | (1.108) |
| Südkorea | | | | 3.255 | Daewoong Co Ltd | Citibank | (1.457) |
| (4.940) | ABLBio Inc | Citibank | (654) | 563 | Daewoong Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (1.276) |
| (193) | ABLBio Inc | HSBC | (167) | (1.729) | Daou Data Corp | Citibank | 1.501 |
| (286) | ABLBio Inc | JP Morgan | (247) | (85) | Daou Data Corp | JP Morgan | 42 |
| 427 | Aekyung Industrial Co Ltd | JP Morgan | (484) | 1.393 | Daou Technology Inc | JP Morgan | 178 |
| 817 | AfreecaTV Co Ltd | Citibank | (2.425) | (1.342) | Dawonsys Co Ltd | Citibank | (1.102) |
| 421 | AfreecaTV Co Ltd | JP Morgan | (1.038) | (914) | Dawonsys Co Ltd | HSBC | (1.128) |
| 83 | Ahnlab Inc [†] | JP Morgan | — | (1.381) | Dawonsys Co Ltd | JP Morgan | (1.699) |
| (1.575) | Alteogen Inc | Citibank | (2.157) | (905) | DB HiTek Co Ltd | Citibank | 214 |
| (884) | Alteogen Inc | JP Morgan | (3.484) | (3.591) | DB HiTek Co Ltd | JP Morgan | 3.229 |
| 1.502 | AMOREPACIFIC Group | Citibank | (3.291) | (34) | Devsisters Co Ltd | JP Morgan | 261 |
| 6.885 | AMOREPACIFIC Group | JP Morgan | (19.486) | 4.904 | DGB Financial Group Inc | JP Morgan | 26 |
| 723 | Amotech Co Ltd | Citibank | (18) | 1.156 | DIO Corp | Citibank | (1.222) |
| (25.240) | Ananti Inc | Citibank | 7.694 | 861 | DL E&C Co Ltd | Citibank | 67 |
| (1.352) | Ananti Inc | JP Morgan | 347 | (952) | DL E&C Co Ltd | HSBC | (28) |
| 7.266 | Asiana Airlines Inc | Citibank | (3.108) | (518) | DL Holdings Co Ltd | Citibank | 810 |
| (3.929) | BH Co Ltd | Citibank | (2.769) | (318) | DL Holdings Co Ltd | HSBC | 1.060 |
| (481) | BH Co Ltd | JP Morgan | (557) | (255) | DL Holdings Co Ltd | JP Morgan | 853 |
| (1.248) | Bioneer Corp | Citibank | 3.470 | 3.351 | Dongjin Semichem Co Ltd | Citibank | 2.510 |
| 5.026 | BNK Financial Group Inc | JP Morgan | (64) | (1.786) | DongKook Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | 387 |
| (182) | Caregen Co Ltd | Citibank | 1.734 | (151) | DongKook Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 69 |
| (722) | Celltrion Healthcare Co Ltd | Citibank | (3.872) | (790) | Dongkuk Steel Mill Co Ltd | JP Morgan | 343 |
| (820) | Celltrion Healthcare Co Ltd | JP Morgan | (1.706) | (297) | Dongsuh Cos Inc | Citibank | 245 |
| 9 | Celltrion Inc | Citibank | (53) | (1.668) | Dongsuh Cos Inc | JP Morgan | 375 |
| (1.849) | Celltrion Pharm Inc | Citibank | 4.742 | (93) | Dongwha Enterprise Co Ltd | Citibank | (65) |
| (692) | Celltrion Pharm Inc | JP Morgan | (1.883) | (117) | Dongwha Enterprise Co Ltd | JP Morgan | 12 |
| (6.417) | Chabiotech Co Ltd | Citibank | (1.636) | (726) | Dongwon Industries Co Ltd | Citibank | 778 |
| 1.834 | Cheil Worldwide Inc | HSBC | (1.015) | (466) | Dongwon Industries Co Ltd | JP Morgan | (150) |
| 465 | Chips&Media Inc | JP Morgan | 2.239 | (897) | Dongwon Systems Corp | Citibank | 800 |
| 251 | Chong Kun Dang Pharmaceutical Corp | JP Morgan | 110 | 2.139 | Doosan Bobcat Inc | HSBC | 2.367 |
| (837) | Chunbo Co Ltd | Citibank | (1.147) | 699 | Doosan Co Ltd | Citibank | (246) |
| (7) | Chunbo Co Ltd | JP Morgan | 9 | | | | |
| 3.099 | CJ CGV Co Ltd | Citibank | 784 | | | | |
| (325) | CJ CheilJedang Corp | Citibank | 5.082 | | | | |
| (14) | CJ CheilJedang Corp | HSBC | 147 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---------------------------------------|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Südkorea Fortsetzung | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| 4 | Doosan Co Ltd | HSBC | 7 | (1.313) | Harim Holdings Co Ltd | JP Morgan | 993 |
| (1.699) | Doosan Enerbility Co Ltd | Citibank | 528 | 2.506 | HD Hyundai Co Ltd | JP Morgan | (3.931) |
| (7.206) | Doosan Enerbility Co Ltd | JP Morgan | (1.055) | 650 | HD Hyundai Construction Equipment Co Ltd | Citibank | (1.384) |
| (7.889) | Doosan Fuel Cell Co Ltd | Citibank | (519) | 298 | HD Hyundai Construction Equipment Co Ltd | JP Morgan | 32 |
| (8.218) | Doosan Fuel Cell Co Ltd | JP Morgan | (2.531) | (342) | HD Hyundai Heavy Industries Co Ltd | JP Morgan | (1.721) |
| (1.784) | Doosan Tesna Inc | JP Morgan | (1.853) | 20.367 | HD Hyundai Infracore Co Ltd | JP Morgan | (9.385) |
| (436) | DoubleUGames Co Ltd | Citibank | 944 | 3.526 | HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd | HSBC | 31.148 |
| (76) | DoubleUGames Co Ltd | JP Morgan | 208 | 1.351 | HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd | JP Morgan | 11.907 |
| (2.529) | Duk San Neolux Co Ltd | Citibank | (1.991) | 10.930 | Helixmith Co Ltd | JP Morgan | (4.518) |
| (129) | Duk San Neolux Co Ltd | JP Morgan | (252) | 13.771 | Hite Jinro Co Ltd | Citibank | (12.078) |
| (209) | Ecopro BM Co Ltd | JP Morgan | (920) | 11.157 | Hite Jinro Co Ltd | JP Morgan | 768 |
| (41) | Ecopro Co Ltd | Citibank | 244 | (585) | HK inno N Corp | Citibank | 80 |
| (72) | Ecopro Co Ltd | JP Morgan | 4.234 | (563) | HK inno N Corp | JP Morgan | (110) |
| (79) | Ecopro HN Co Ltd | Citibank | 109 | 4.811 | HL Mando Co Ltd | Citibank | 1.538 |
| (60) | Ecopro HN Co Ltd | JP Morgan | 195 | 2.718 | HL Mando Co Ltd | HSBC | 5.627 |
| 1.061 | Eo Technics Co Ltd | JP Morgan | 2.377 | (1.051) | HLB Inc | Citibank | (1.551) |
| 3.256 | Eugene Technology Co Ltd | Citibank | 341 | (329) | HLB Inc | JP Morgan | (280) |
| 1.936 | Eugene Technology Co Ltd | JP Morgan | 1.593 | (3.489) | HMM Co Ltd | Citibank | 3.338 |
| (98) | F&F Co Ltd | Citibank | 497 | (6.089) | HMM Co Ltd | JP Morgan | 10.992 |
| (1.252) | F&F Co Ltd | JP Morgan | 13.973 | 706 | Hotel Shilla Co Ltd | JP Morgan | (3.029) |
| 1.276 | Fila Holdings Corp | Citibank | (1.159) | (770) | HPSP Co Ltd | Citibank | (1.556) |
| (367) | Fila Holdings Corp | Citibank | 273 | 2.474 | Hugel Inc | Citibank | (5.145) |
| (395) | Fila Holdings Corp | JP Morgan | 235 | 233 | Hugel Inc | JP Morgan | (1.044) |
| (3.739) | Foosung Co Ltd | Citibank | (644) | (3.541) | Humasis Co Ltd | Citibank | (967) |
| (1.507) | Foosung Co Ltd | JP Morgan | 74 | 396 | Humedix Co Ltd | Citibank | 206 |
| (5.887) | GemVax & Kael Co Ltd | Citibank | (3.852) | 1.995 | Huons Co Ltd | JP Morgan | (2.359) |
| (1.762) | GemVax & Kael Co Ltd | JP Morgan | (1.767) | (128) | HYBE Co Ltd | JP Morgan | 611 |
| 22.174 | Genexine Inc | JP Morgan | (3.216) | 63 | Hy-Lok Corp | Citibank | 56 |
| (374) | GOLFZON Co Ltd | Citibank | 1.725 | (7) | Hyosung Advanced Materials Corp | Citibank | 80 |
| (392) | GOLFZON Co Ltd | JP Morgan | 1.944 | (202) | Hyosung Advanced Materials Corp | JP Morgan | (4.033) |
| (132) | Grand Korea Leisure Co Ltd | Citibank | 85 | (1.181) | Hyosung Corp | Citibank | 1.384 |
| (124) | Grand Korea Leisure Co Ltd | JP Morgan | (113) | (126) | Hyosung Corp | HSBC | 199 |
| 7.105 | Green Cross Holdings Corp | Citibank | (3.588) | (1.066) | Hyosung Corp | JP Morgan | 1.704 |
| 17.088 | GS Engineering & Construction Corp | JP Morgan | (12.296) | (114) | Hyosung TNC Corp | Citibank | 1.997 |
| (3.547) | Hana Financial Group Inc | Citibank | 1.971 | (131) | Hyosung TNC Corp | JP Morgan | 3.056 |
| (609) | Hana Materials Inc | JP Morgan | (1.165) | 215 | Hyundai Autoever Corp | JP Morgan | (8) |
| (15.174) | Hana Micron Inc | Citibank | 11.750 | (43) | Hyundai Bioscience Co Ltd | HSBC | 36 |
| (326) | Hana Micron Inc | JP Morgan | (437) | (1.652) | Hyundai Department Store Co Ltd | Citibank | 3.444 |
| (220) | Hanall Biopharma Co Ltd | Citibank | (42) | 1.017 | Hyundai Department Store Co Ltd | JP Morgan | (1.188) |
| (3.146) | Hanall Biopharma Co Ltd | JP Morgan | 726 | (74) | Hyundai Department Store Co Ltd | JP Morgan | 86 |
| 1.974 | Hancom Inc | Citibank | 358 | 613 | Hyundai Elevator Co Ltd | Citibank | (1.179) |
| 4.661 | Handsome Co Ltd | HSBC | (8.475) | 218 | Hyundai Engineering & Construction Co Ltd | Citibank | (432) |
| 8.078 | Handsome Co Ltd | JP Morgan | (15.172) | 909 | Hyundai Engineering & Construction Co Ltd | HSBC | (2.078) |
| (1.939) | Hanil Cement Co Ltd | Citibank | 217 | 1.990 | Hyundai Glovis Co Ltd | Citibank | (9.741) |
| (2.789) | Hanjin Kal Corp | Citibank | (12.385) | 1.755 | Hyundai Home Shopping Network Corp | JP Morgan | (3.815) |
| (157) | Hanjin Kal Corp | JP Morgan | (1.029) | 2.415 | Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd | Citibank | (2.242) |
| (977) | Hankook Tire & Technology Co Ltd | Citibank | 1.842 | 1.503 | Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd | HSBC | (5.739) |
| (656) | Hankook Tire & Technology Co Ltd | JP Morgan | 628 | (41) | Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd | JP Morgan | (91) |
| 3.710 | Hanon Systems | JP Morgan | (434) | 377 | Hyundai Mobis Co Ltd | Citibank | (1.982) |
| 1.101 | Hansae Co Ltd | Citibank | (575) | 1.785 | Hyundai Motor Co | JP Morgan | (4.665) |
| 7.865 | Hansae Co Ltd | JP Morgan | (5.027) | 250 | Hyundai Rotem Co Ltd | Citibank | (249) |
| (785) | Hansol Chemical Co Ltd | Citibank | (1.442) | | | | |
| (685) | Hansol Chemical Co Ltd | JP Morgan | (3.686) | | | | |
| 1.040 | Hanwha Aerospace Co Ltd | Citibank | (3.766) | | | | |
| 1.127 | Hanwha Aerospace Co Ltd | JP Morgan | 507 | | | | |
| 60.149 | Hanwha Investment & Securities Co Ltd | Citibank | (2.446) | | | | |
| (5.983) | Hanwha Life Insurance Co Ltd | JP Morgan | (59) | | | | |
| 12.661 | Hanwha Life Insurance Co Ltd | JP Morgan | 124 | | | | |
| (1.243) | Hanwha Solutions Corp | JP Morgan | 1.142 | | | | |
| (617) | Hanwha Systems Co Ltd | Citibank | 312 | | | | |
| (86) | Hanwha Systems Co Ltd | JP Morgan | 14 | | | | |
| (7.287) | Harim Holdings Co Ltd | Citibank | 4.897 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|-------------|---|
| Südkorea Fortsetzung | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| 14.928 | Hyundai Steel Co | Citibank | (33.094) | 3.279 | KT Corp | JP Morgan | 1.613 |
| 5.982 | Hyundai Wia Corp | Citibank | (4.622) | (1.485) | Kumho Petrochemical Co | | |
| 89 | Hyundai Wia Corp | HSBC | 231 | | Ltd | Citibank | 7.959 |
| 27.056 | Iijin Holdings Co Ltd | JP Morgan | (1.777) | (429) | Kumho Petrochemical Co | | |
| (112) | Iijin Hysolus Co Ltd | Citibank | 26 | | Ltd | JP Morgan | 3.054 |
| 1.069 | InBody Co Ltd | Citibank | (310) | (3.063) | Kumho Tire Co Inc | Citibank | 562 |
| 6.628 | Incross Co Ltd | JP Morgan | 508 | (5.716) | Kumho Tire Co Inc | JP Morgan | 558 |
| (17.047) | Industrial Bank of Korea | Citibank | 2.452 | (1.971) | L&C Bio Co Ltd | Citibank | (3.090) |
| (295) | Industrial Bank of Korea | JP Morgan | (14) | (116) | L&C Bio Co Ltd | HSBC | (290) |
| (2.155) | Innox Advanced Materials Co Ltd | | | (1.308) | L&C Bio Co Ltd | JP Morgan | (3.255) |
| (120) | Innox Advanced Materials Co Ltd | Citibank | 2.164 | (278) | L&F Co Ltd | Citibank | (3.619) |
| | | JP Morgan | (87) | (328) | L&F Co Ltd | JP Morgan | (4.647) |
| (31.636) | Insun ENT Co Ltd | Citibank | 1.873 | (283) | Lake Materials Co Ltd | JP Morgan | 238 |
| (10.671) | Insun ENT Co Ltd | JP Morgan | (723) | (15) | LEENO Industrial Inc | JP Morgan | 33 |
| (4.749) | Intellian Technologies Inc | Citibank | 33.372 | (2.786) | LegoChem Biosciences Inc | Citibank | 3.236 |
| (443) | Intellian Technologies Inc | JP Morgan | 746 | (1.027) | LegoChem Biosciences Inc | JP Morgan | (1.791) |
| (791) | Intellian Technologies Inc (Right) | | | (2.764) | LG Corp | Citibank | 7.520 |
| (73) | Intellian Technologies Inc (Right) | Citibank | (5.722) | (183) | LG Corp | JP Morgan | 639 |
| | | JP Morgan | (528) | 5.722 | LG Display Co Ltd | HSBC | 2.252 |
| (3.402) | INTOPS Co Ltd | Citibank | (1.053) | (21) | LG Energy Solution Ltd | JP Morgan | (606) |
| (629) | IS Dongseo Co Ltd | Citibank | 908 | 61 | LG H&H Co Ltd | JP Morgan | (2.887) |
| (1.830) | IS Dongseo Co Ltd | JP Morgan | 521 | 5.198 | LG HelloVision Co Ltd | Citibank | 769 |
| (448) | ISC Co Ltd | Citibank | (1.571) | 20.076 | LG HelloVision Co Ltd | HSBC | 3.728 |
| (326) | ISC Co Ltd | JP Morgan | (2.975) | (31) | LG Innotek Co Ltd | Citibank | (374) |
| (4.557) | ITM Semiconductor Co Ltd | Citibank | 1.619 | (28) | LG Innotek Co Ltd | HSBC | (681) |
| 30.568 | JB Financial Group Co Ltd | Citibank | 47 | (93) | LG Innotek Co Ltd | JP Morgan | (2.256) |
| (2.751) | Jusung Engineering Co Ltd | Citibank | 1.135 | 23.855 | LG Uplus Corp | JP Morgan | 298 |
| (2.007) | Jusung Engineering Co Ltd | HSBC | (935) | 408 | Lotte Chemical Corp | JP Morgan | (1.110) |
| (179) | Jusung Engineering Co Ltd | JP Morgan | (83) | 291 | Lotte Chilsung Beverage Co Ltd | | |
| 5.933 | JVM Co Ltd | Citibank | (3.194) | 4.371 | Lotte Corp | JP Morgan | (1.602) |
| 910 | JW Pharmaceutical Corp | Citibank | (1.041) | (56) | Lotte Energy Materials Corp | HSBC | 227 |
| 2.500 | JW Pharmaceutical Corp | HSBC | (195) | (1.955) | Lotte Energy Materials Corp | JP Morgan | 7.952 |
| (1.568) | JYP Entertainment Corp | Citibank | (8.408) | (129) | LOTTE Fine Chemical Co Ltd | | |
| (113) | JYP Entertainment Corp | JP Morgan | (2.500) | (27) | LOTTE Fine Chemical Co Ltd | Citibank | 137 |
| 5.879 | K Car Co Ltd | JP Morgan | (8.023) | | Ltd | HSBC | 65 |
| (736) | Kakao Corp | Citibank | 1.163 | (604) | LOTTE Fine Chemical Co Ltd | | |
| (540) | Kakao Corp | JP Morgan | 723 | 132 | Lotte IT Tech Co Ltd | JP Morgan | 1.455 |
| 90 | Kakaopay Corp | Citibank | 156 | 2.383 | Lotte Shopping Co Ltd | JP Morgan | 31 |
| 876 | KB Financial Group Inc | Citibank | (113) | (23.627) | Lotte Tour Development Co Ltd | Citibank | (4.963) |
| 495 | KCC Corp | Citibank | (3.155) | | Ltd | | |
| 737 | KCC Corp | JP Morgan | (6.096) | (87) | Lotte Tour Development Co Ltd | Citibank | 11.746 |
| (2.367) | KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd | | | (374) | Lotte Tour Development Co Ltd | HSBC | (9) |
| (1.342) | KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd | Citibank | 2.840 | | Ltd | | |
| | | JP Morgan | 1.942 | | Ltd | JP Morgan | (39) |
| 5.970 | Kginicis Co Ltd | JP Morgan | 461 | (355) | LS Corp | Citibank | 683 |
| 2.518 | Kia Corp | Citibank | (6.658) | 104 | LS Corp | JP Morgan | (928) |
| (92) | KIWOOM Securities Co Ltd | Citibank | 114 | (196) | LS Corp | JP Morgan | 328 |
| (56) | KIWOOM Securities Co Ltd | JP Morgan | (70) | 3.776 | LS Electric Co Ltd | Citibank | 1.047 |
| 4.677 | KMW Co Ltd | JP Morgan | (295) | 2.029 | LS Electric Co Ltd | JP Morgan | (2.002) |
| 6.958 | Koh Young Technology Inc | Citibank | 684 | 6.199 | LX Hausys Ltd | JP Morgan | 14.056 |
| 5.412 | Koh Young Technology Inc | HSBC | 2.288 | (119) | LX INTERNATIONAL Corp | Citibank | 172 |
| 8.147 | Koh Young Technology Inc | JP Morgan | 3.418 | (275) | LX INTERNATIONAL Corp | JP Morgan | 196 |
| (4.649) | Kolmar BNH Co Ltd | Citibank | 2.094 | 130 | LX Semicon Co Ltd | Citibank | 544 |
| (69) | Kolmar BNH Co Ltd | JP Morgan | 63 | 936 | MAKUS Inc | Citibank | 2.533 |
| (72) | Kolmar Korea Co Ltd | Citibank | 50 | 1.038 | MedPacto Inc | JP Morgan | (593) |
| (438) | Kolmar Korea Co Ltd | JP Morgan | 656 | (20) | Medytox Inc | Citibank | (437) |
| 842 | Kolon Industries Inc | HSBC | (376) | (31) | Medytox Inc | JP Morgan | (33) |
| 3.868 | Kolon Industries Inc | JP Morgan | (1.768) | (67) | MegaStudyEdu Co Ltd | Citibank | 53 |
| 3.130 | Korea Gas Corp | Citibank | (425) | (191) | MegaStudyEdu Co Ltd | JP Morgan | (332) |
| (560) | Korea Petrochemical Ind Co Ltd | | | (1.082) | Meritz Financial Group Inc | HSBC | 573 |
| (170) | Korea Petrochemical Ind Co Ltd | Citibank | 3.707 | (3.345) | Meritz Financial Group Inc | JP Morgan | 1.808 |
| | | JP Morgan | 804 | (295) | Mirae Asset Securities Co Ltd | | |
| (403) | Korea Zinc Co Ltd | Citibank | 6.046 | | Ltd | Citibank | (5) |
| (24) | Korea Zinc Co Ltd | JP Morgan | 559 | (1.584) | Mirae Asset Securities Co Ltd | | |
| 2.753 | Korean Reinsurance Co | Citibank | (1.166) | (4.256) | Mirae Asset Securities Co Ltd | HSBC | (417) |
| (198) | Krafton Inc | JP Morgan | 2.219 | | Ltd | JP Morgan | (1.112) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|-----------------------------------|-------------|---|-----------------------------|--|-------------|---|
| Südkorea Fortsetzung | | | | Südkorea Fortsetzung | | | |
| (3.134) | Modetour Network Inc | Citibank | 1.323 | (1.002) | Samsung Engineering Co Ltd | Citibank | 1.743 |
| (343) | Modetour Network Inc | JP Morgan | (7) | 34.296 | Samsung Heavy Industries Co Ltd | JP Morgan | 17.158 |
| (1.490) | Myoung Shin Industrial Co Ltd | Citibank | 195 | (5.973) | Samsung Life Insurance Co Ltd | Citibank | 5.673 |
| (8.500) | Myoung Shin Industrial Co Ltd | JP Morgan | (19.048) | (89) | Samsung SDI Co Ltd | Citibank | (885) |
| 5.640 | Nasmedia Co Ltd | Citibank | (1.457) | (12) | Samsung SDI Co Ltd | JP Morgan | (278) |
| (4.018) | Nature Holdings Co Ltd | Citibank | 2.065 | 1.170 | Samsung SDS Co Ltd | Citibank | (308) |
| (255) | Nature Holdings Co Ltd | JP Morgan | 411 | (120) | Samsung Securities Co Ltd | Citibank | (68) |
| (3.392) | Naturecell Co Ltd | Citibank | 773 | (491) | Samsung Securities Co Ltd | HSBC | (552) |
| (1.157) | Naturecell Co Ltd | JP Morgan | 472 | (420) | Samsung Securities Co Ltd | JP Morgan | (469) |
| 858 | NCSOFT Corp | JP Morgan | (49.384) | 944 | Samwha Capacitor Co Ltd | Citibank | 506 |
| 894 | Netmarble Corp | Citibank | (2.137) | (1.661) | Samyang Foods Co Ltd | Citibank | 579 |
| (740) | NEXTIN Inc | Citibank | (5.173) | 3.964 | SeAH Besteel Holdings Corp | Citibank | 205 |
| (61) | NEXTIN Inc | JP Morgan | (438) | (188) | Seegene Inc | Citibank | (105) |
| (2.222) | NH Investment & Securities Co Ltd | JP Morgan | (963) | (126) | Seegene Inc | JP Morgan | 40 |
| 4.158 | NHN Corp | Citibank | (3.347) | (526) | Seobu T&D | Citibank | 93 |
| 17.084 | NHN KCP Corp | Citibank | (336) | (7.079) | Seojin System Co Ltd | Citibank | (305) |
| 770 | NKMax Co Ltd | Citibank | 383 | (2.427) | Seojin System Co Ltd | JP Morgan | 347 |
| (486) | NongShim Co Ltd | Citibank | (8.851) | 1.113 | Seoul Semiconductor Co Ltd | JP Morgan | 263 |
| (237) | Orion Holdings Corp | Citibank | 136 | (7.831) | SFA Engineering Corp | Citibank | 5.164 |
| (516) | Orion Holdings Corp | HSBC | 608 | (578) | SFA Engineering Corp | JP Morgan | 206 |
| (94) | Orion Holdings Corp | JP Morgan | 111 | 221 | Shinsegae Inc | JP Morgan | (2.132) |
| (2.373) | Oscotec Inc | Citibank | 3.440 | 4.146 | Shinsegae Information & Communication Co Ltd | Citibank | 30 |
| (540) | Oscotec Inc | JP Morgan | 453 | 4.595 | Shinsegae International Inc | JP Morgan | (6.187) |
| (8) | Ottogi Corp | Citibank | 93 | (1.495) | SIMMTECH Co Ltd | Citibank | (746) |
| 10.547 | Paradise Co Ltd | Citibank | (7.584) | (207) | SIMMTECH Co Ltd | JP Morgan | (517) |
| 5.354 | Paradise Co Ltd | JP Morgan | (2.344) | (710) | SK Biopharmaceuticals Co Ltd | Citibank | (376) |
| (56) | Park Systems Corp | Citibank | (440) | (54) | SK Biopharmaceuticals Co Ltd | HSBC | (113) |
| (36) | Park Systems Corp | JP Morgan | (271) | (45) | SK Biopharmaceuticals Co Ltd | JP Morgan | (94) |
| (152) | Pearl Abyss Corp | Citibank | (371) | (43) | SK Bioscience Co Ltd | Citibank | (73) |
| (122) | Pearl Abyss Corp | JP Morgan | (294) | (186) | SK Bioscience Co Ltd | JP Morgan | (677) |
| (822) | People & Technology Inc | Citibank | (276) | 33 | SK Chemicals Co Ltd | JP Morgan | 80 |
| (2.228) | People & Technology Inc | JP Morgan | 532 | 71 | SK Gas Ltd | Citibank | (165) |
| 59 | PharmaResearch Co Ltd | JP Morgan | (103) | (69) | SK IE Technology Co Ltd | JP Morgan | (374) |
| (701) | PI Advanced Materials Co Ltd | Citibank | 14 | (653) | SK Inc | Citibank | 2.945 |
| (704) | PI Advanced Materials Co Ltd | JP Morgan | (368) | (14) | SK Inc | JP Morgan | (1) |
| (16.798) | Posco DX Co Ltd | Citibank | 4.591 | 2 | SK Innovation Co Ltd | Citibank | 11 |
| (3.002) | Posco DX Co Ltd | JP Morgan | 3.192 | 39.336 | SK Networks Co Ltd | Citibank | 4.834 |
| (488) | POSCO Future M Co Ltd | JP Morgan | (9.913) | (4.202) | SK oceanplant Co Ltd | Citibank | 2.305 |
| (318) | POSCO Holdings Inc | Citibank | 2.763 | (3.249) | SK Square Co Ltd | Citibank | (1.566) |
| (30) | POSCO Holdings Inc | JP Morgan | 209 | (86) | SK Square Co Ltd | HSBC | (250) |
| 515 | Posco International Corp | Citibank | (217) | (265) | SK Square Co Ltd | JP Morgan | (768) |
| 4.897 | Power Logics Co Ltd | JP Morgan | 1.876 | 1.471 | SKC Co Ltd | Citibank | (2.061) |
| (3.013) | PSK Inc | Citibank | 1.020 | 2.580 | SL Corp | Citibank | (1.753) |
| (78) | PSK Inc | JP Morgan | (53) | 3.819 | SL Corp | JP Morgan | 14.971 |
| (5.224) | RFHIC Corp | Citibank | (3.333) | 526 | S-Oil Corp | JP Morgan | (575) |
| (690) | RFHIC Corp | JP Morgan | (464) | (2.079) | Soulbrain Co Ltd | Citibank | 7.372 |
| (618) | S&S Tech Corp | Citibank | (2.387) | (20) | Soulbrain Co Ltd | HSBC | (68) |
| (333) | S&S Tech Corp | JP Morgan | (1.215) | 938 | SPC Samlip Co Ltd | JP Morgan | 660 |
| 504 | S-1 Corp | Citibank | (211) | (39.863) | SSANGYONG C&E Co Ltd | Citibank | 2.316 |
| (858) | Sam Chun Dang Pharm Co Ltd | Citibank | 1.121 | (2.585) | SSANGYONG C&E Co Ltd | JP Morgan | 219 |
| (326) | Sam Chun Dang Pharm Co Ltd | JP Morgan | 1.134 | (4.544) | STCUBE | Citibank | (5.538) |
| (227) | Samsung Biologics Co Ltd | Citibank | 1.437 | 1.271 | Studio Dragon Corp | Citibank | (1.294) |
| 1.069 | Samsung C&T Corp | HSBC | (560) | (1.242) | Taeyoung Engineering & Construction Co Ltd | Citibank | — |
| 9.634 | Samsung Card Co Ltd | JP Morgan | (1.773) | 4.812 | TES Co Ltd | Citibank | (2.369) |
| (1) | Samsung Electro-Mechanics Co Ltd | Citibank | (3) | 404 | TKG Huchems Co Ltd | Citibank | (308) |
| (162) | Samsung Electro-Mechanics Co Ltd | JP Morgan | (834) | 3.113 | TKG Huchems Co Ltd | HSBC | (1.414) |
| (2.752) | Samsung Electronics Co Ltd | Citibank | (5.038) | (118) | Tokai Carbon Korea Co Ltd | Citibank | (113) |
| (834) | Samsung Electronics Co Ltd | JP Morgan | (3.258) | (28) | Tokai Carbon Korea Co Ltd | JP Morgan | (174) |
| 90 | Samsung Electronics Co Ltd (Pref) | JP Morgan | 179 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|---------------------------|--|-------------|---|
| Südkorea Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| 2.228 | Union Semiconductor Equipment & Materials Co Ltd | Citibank | (480) | 20.000 | Asia Optical Co Inc | Citibank | 907 |
| (609) | Vaxcell-Bio Therapeutics Co Ltd | Citibank | 679 | 3.000 | Asia Vital Components Co Ltd | HSBC | 2.187 |
| 1.601 | Vitzrocell Co Ltd | JP Morgan | 862 | 1.000 | ASMedia Technology Inc | Citibank | (2.508) |
| (160) | Wemade Co Ltd | JP Morgan | 457 | 1.000 | ASMedia Technology Inc | JP Morgan | (1.059) |
| 2.993 | WONIK IPS Co Ltd | Citibank | (1.294) | (8.000) | Asustek Computer Inc | JP Morgan | (4.083) |
| (1.434) | WONIK IPS Co Ltd | Citibank | 620 | 55.000 | AUO Corp | HSBC | 559 |
| (1.430) | Wonik QnC Corp | Citibank | 1.006 | 5.000 | Axiomtek Co Ltd | JP Morgan | (157) |
| (92) | Wonik QnC Corp | JP Morgan | (85) | 37.000 | BenQ Materials Corp | Citibank | 170 |
| (5.640) | Woori Financial Group Inc | Citibank | 563 | 77.000 | BenQ Materials Corp | HSBC | 2.444 |
| (2.942) | Woori Financial Group Inc | HSBC | (349) | 99.000 | BenQ Materials Corp | JP Morgan | 3.068 |
| (1.915) | Woori Financial Group Inc | JP Morgan | (222) | (1.000) | Bora Pharmaceuticals Co Ltd | JP Morgan | 564 |
| (16.988) | Wysiwyg Studios Co Ltd | Citibank | 11.400 | (231.000) | Brighton-Best International Taiwan Inc | Citibank | (2.947) |
| (1.768) | Wysiwyg Studios Co Ltd | JP Morgan | 1.301 | (6.000) | Brighton-Best International Taiwan Inc | HSBC | 113 |
| (1.081) | YG Entertainment Inc | Citibank | (2.017) | (209.000) | Brighton-Best International Taiwan Inc | JP Morgan | 3.863 |
| 531 | YG Entertainment Inc | Citibank | 686 | 4.000 | Capital Securities Corp | JP Morgan | (25) |
| (116) | YG Entertainment Inc | JP Morgan | (2.665) | 35.000 | Center Laboratories Inc | HSBC | (1.608) |
| 494 | Youngone Corp | Citibank | (546) | 45.000 | Center Laboratories Inc | JP Morgan | (2.118) |
| 7.290 | Youngone Corp | JP Morgan | (4.493) | (14.000) | Century Iron & Steel Industrial Co Ltd | Citibank | (2.884) |
| (1.167) | Yuhan Corp | HSBC | (1.269) | (26.000) | Century Iron & Steel Industrial Co Ltd | JP Morgan | 262 |
| (39) | Yuhan Corp | JP Morgan | (42) | 1.450 | Chailease Holding Co Ltd | Citibank | (607) |
| | | | (138.859) | 2.250 | Chailease Holding Co Ltd | JP Morgan | (1.768) |
| Taiwan | | | | 213.110 | Chang Hwa Commercial Bank Ltd | Citibank | (2.639) |
| 1.000 | 91APP Inc | JP Morgan | (844) | 133.320 | Chang Hwa Commercial Bank Ltd | HSBC | (169) |
| (47.000) | AcBel Polytech Inc | Citibank | (1.878) | 122.210 | Chang Hwa Commercial Bank Ltd | JP Morgan | (203) |
| (68.000) | AcBel Polytech Inc | JP Morgan | (5.154) | (46.000) | Chang Wah Electromaterials Inc | Citibank | (1.033) |
| 1.000 | Accton Technology Corp | Citibank | 2.230 | (71.000) | Chang Wah Electromaterials Inc | JP Morgan | (3.814) |
| 1.000 | Accton Technology Corp | HSBC | 1.867 | (2.000) | Chang Wah Technology Co Ltd | Citibank | 63 |
| 5.000 | Accton Technology Corp | JP Morgan | 9.301 | (5.000) | Chang Wah Technology Co Ltd | HSBC | (132) |
| (148.000) | Acer Inc | JP Morgan | (8.997) | (5.000) | Chang Wah Technology Co Ltd | JP Morgan | (127) |
| 3.000 | ADATA Technology Co Ltd | HSBC | 1.527 | 4.000 | Changs Ascending Enterprise Co Ltd | JP Morgan | 107 |
| 18.000 | ADATA Technology Co Ltd | JP Morgan | 9.133 | 3.000 | CHC Healthcare Group | Citibank | (450) |
| (22.000) | Adimmune Corp | Citibank | (456) | 3.000 | CHC Healthcare Group | HSBC | (826) |
| (9.000) | Adimmune Corp | JP Morgan | 385 | 10.000 | CHC Healthcare Group | JP Morgan | (2.768) |
| (35.000) | Advanced Wireless Semiconductor Co | Citibank | (2.924) | (18.000) | Chenbro Micom Co Ltd | Citibank | (14.556) |
| (26.000) | Advanced Wireless Semiconductor Co | JP Morgan | (1.413) | (2.000) | Chenbro Micom Co Ltd | HSBC | (1.973) |
| 7.000 | Advantech Co Ltd | Citibank | 1.101 | (6.000) | Chenbro Micom Co Ltd | JP Morgan | (5.908) |
| 1.000 | Advantech Co Ltd | HSBC | 803 | (35.000) | Cheng Loong Corp | Citibank | 60 |
| 14.000 | Advantech Co Ltd | JP Morgan | 11.125 | (3.000) | Cheng Loong Corp | HSBC | 178 |
| 1.000 | Airtac International Group | Citibank | (2.759) | (63.000) | Cheng Loong Corp | JP Morgan | 3.783 |
| 1.000 | Airtac International Group | HSBC | (1.962) | (5.000) | Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd | JP Morgan | (47) |
| 3.000 | Airtac International Group | JP Morgan | (5.954) | (7.000) | Cheng Uei Precision Industry Co Ltd | Citibank | (292) |
| (1.000) | Alltop Technology Co Ltd | HSBC | (495) | (6.000) | Cheng Uei Precision Industry Co Ltd | JP Morgan | 92 |
| (7.000) | Alltop Technology Co Ltd | JP Morgan | (3.444) | 5.000 | Chicony Electronics Co Ltd | Citibank | 216 |
| (7.000) | AP Memory Technology Corp | Citibank | (7.972) | 51.000 | Chicony Electronics Co Ltd | HSBC | 11.594 |
| (1.000) | AP Memory Technology Corp | HSBC | (1.835) | 54.000 | Chicony Electronics Co Ltd | JP Morgan | 12.160 |
| (4.000) | AP Memory Technology Corp | JP Morgan | (7.316) | 4.000 | Chicony Power Technology Co Ltd | JP Morgan | 530 |
| (12.000) | Apex International Co Ltd | Citibank | (546) | (305.000) | China Development Financial Holding Corp | Citibank | 6.175 |
| (2.000) | Apex International Co Ltd | HSBC | (493) | (52.000) | China Development Financial Holding Corp | HSBC | 216 |
| (36.000) | Apex International Co Ltd | JP Morgan | (8.837) | | | | |
| 7.000 | Argosy Research Inc | Citibank | (41) | | | | |
| 1.000 | Argosy Research Inc | HSBC | 90 | | | | |
| 20.000 | Argosy Research Inc | JP Morgan | 1.620 | | | | |
| 21.000 | ASE Technology Holding Co Ltd | Citibank | 900 | | | | |
| 22.000 | ASE Technology Holding Co Ltd | HSBC | 5.208 | | | | |
| 13.000 | ASE Technology Holding Co Ltd | JP Morgan | 3.048 | | | | |
| 21.000 | Asia Cement Corp | Citibank | (426) | | | | |
| 4.000 | Asia Cement Corp | HSBC | (84) | | | | |
| 19.000 | Asia Cement Corp | JP Morgan | (418) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|-------------|---|---------------------------|---|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| (214.000) | China Development Financial Holding Corp | JP Morgan | 950 | (37.513) | E.Sun Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (1.073) |
| 202.000 | China Man-Made Fiber Corp | Citibank | (813) | (19.000) | Eastech Holding Ltd | Citibank | 3.020 |
| 11.000 | China Motor Corp | Citibank | 2.776 | (1.000) | Eastech Holding Ltd | JP Morgan | 160 |
| 1.000 | China Motor Corp | HSBC | 515 | (5.000) | Eclat Textile Co Ltd | JP Morgan | 3.154 |
| 9.000 | China Motor Corp | JP Morgan | 4.620 | 2.000 | eCloudvalley Digital Technology Co Ltd | Citibank | (213) |
| (403.000) | China Petrochemical Development Corp | Citibank | (180) | 1.000 | eCloudvalley Digital Technology Co Ltd | HSBC | 425 |
| (10.000) | China Petrochemical Development Corp | HSBC | 56 | 1.000 | eCloudvalley Digital Technology Co Ltd | JP Morgan | 136 |
| (395.388) | China Petrochemical Development Corp | JP Morgan | 2.294 | (1.000) | EirGenix Inc | HSBC | 399 |
| (16.000) | China Steel Chemical Corp | Citibank | (163) | (15.000) | EirGenix Inc | JP Morgan | 5.422 |
| (9.000) | China Steel Chemical Corp | JP Morgan | 388 | 16.000 | Elan Microelectronics Corp | Citibank | 1.685 |
| (201.000) | China Steel Corp | Citibank | 6.868 | 4.000 | Elan Microelectronics Corp | HSBC | 1.119 |
| (104.000) | China Steel Corp | HSBC | 1.230 | 11.000 | Elan Microelectronics Corp | JP Morgan | 3.056 |
| 2.000 | Chipbond Technology Corp | Citibank | 58 | (5.000) | Elite Material Co Ltd | Citibank | (3.203) |
| 55.000 | ChipMOS Technologies Inc | Citibank | 1.773 | (7.000) | Elite Material Co Ltd | JP Morgan | (8.773) |
| 46.000 | ChipMOS Technologies Inc | HSBC | 697 | (1.000) | Elite Semiconductor Microelectronics Technology Inc | HSBC | (362) |
| 16.000 | ChipMOS Technologies Inc | JP Morgan | 446 | (7.000) | Elite Semiconductor Microelectronics Technology Inc | JP Morgan | (2.524) |
| 25.000 | Chroma ATE Inc | Citibank | 25.764 | (66.000) | Elitegroup Computer Systems Co Ltd | Citibank | (3.770) |
| 2.000 | Chroma ATE Inc | HSBC | 2.706 | (2.000) | Elitegroup Computer Systems Co Ltd | HSBC | (214) |
| 19.000 | Chroma ATE Inc | JP Morgan | 25.635 | (64.000) | Elitegroup Computer Systems Co Ltd | JP Morgan | (6.826) |
| 29.000 | Chung Hung Steel Corp | Citibank | (556) | 1.000 | Emerging Display Technologies Corp | HSBC | 86 |
| 8.000 | Chung Hung Steel Corp | HSBC | (352) | 19.038 | Ennoconn Corp | Citibank | 328 |
| 45.000 | Chung Hung Steel Corp | JP Morgan | (2.005) | 10.038 | Ennoconn Corp | HSBC | 7.879 |
| (94.000) | Chung Hwa Pulp Corp | Citibank | (552) | 20.039 | Ennoconn Corp | JP Morgan | 17.459 |
| (3.000) | Chung Hwa Pulp Corp | JP Morgan | 14 | (4.000) | Ennostar Inc | Citibank | (224) |
| (8.000) | Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp | Citibank | 701 | (3.000) | Ennostar Inc | HSBC | (341) |
| (3.000) | Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp | JP Morgan | (814) | (34.500) | Ennostar Inc | JP Morgan | (3.891) |
| (11.000) | Chunghwa Chemical Synthesis & Biotech Co Ltd | Citibank | 2.419 | (6.000) | Episil Technologies Inc | Citibank | (385) |
| (2.000) | Chunghwa Chemical Synthesis & Biotech Co Ltd | JP Morgan | 605 | (10.305) | Episil Technologies Inc | JP Morgan | (395) |
| 11.000 | Chunghwa Telecom Co Ltd | Citibank | 104 | (5.000) | Episil-Precision Inc | Citibank | 50 |
| 4.000 | Chunghwa Telecom Co Ltd | HSBC | (101) | (3.000) | Episil-Precision Inc | JP Morgan | 76 |
| 4.000 | Chunghwa Telecom Co Ltd | JP Morgan | (112) | (3.149) | Etron Technology Inc | JP Morgan | (454) |
| (12.000) | Cleanaway Co Ltd | Citibank | (62) | (4.399) | Ever Supreme Bio Technology Co Ltd | Citibank | (116) |
| (23.000) | Cleanaway Co Ltd | JP Morgan | (6.893) | (1.099) | Ever Supreme Bio Technology Co Ltd | HSBC | 61 |
| (18.000) | Compal Electronics Inc | Citibank | (648) | (144.000) | Evergreen International Storage & Transport Corp | Citibank | 448 |
| (107.000) | Compal Electronics Inc | JP Morgan | (11.074) | (65.000) | Evergreen International Storage & Transport Corp | JP Morgan | (1.320) |
| (87.000) | Compeq Manufacturing Co Ltd | Citibank | (3.621) | (2.000) | Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd | Citibank | 49 |
| (35.000) | Compeq Manufacturing Co Ltd | HSBC | (1.268) | (14.000) | Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd | HSBC | (762) |
| (34.000) | Compeq Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | (274) | (4.000) | Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd | JP Morgan | (205) |
| (4.000) | Coretronic Corp | Citibank | (62) | (8.000) | Everlight Chemical Industrial Corp | Citibank | 126 |
| (17.000) | Coretronic Corp | JP Morgan | 728 | (8.000) | Everlight Chemical Industrial Corp | JP Morgan | 341 |
| 9.000 | Co-Tech Development Corp | Citibank | 119 | 85.000 | Everlight Electronics Co Ltd | Citibank | 4.632 |
| (367.000) | CTBC Financial Holding Co Ltd | Citibank | 3.473 | 12.000 | Everlight Electronics Co Ltd | HSBC | 2.602 |
| (45.000) | CTBC Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (1.294) | 136.000 | Everlight Electronics Co Ltd | JP Morgan | 10.621 |
| 1.000 | Cub Elecparts Inc | HSBC | 37 | 49.000 | Excellence Opto Inc | Citibank | (2.240) |
| (24.000) | Darfon Electronics Corp | Citibank | (487) | 21.000 | Excellence Opto Inc | HSBC | (293) |
| (18.000) | Darfon Electronics Corp | JP Morgan | (1.391) | 18.000 | Excellence Opto Inc | JP Morgan | 78 |
| 2.000 | Delta Electronics Inc | Citibank | 683 | 34.000 | Far Eastern International Bank | HSBC | (27) |
| 4.000 | Delta Electronics Inc | HSBC | 1.346 | | | | |
| 2.000 | Delta Electronics Inc | JP Morgan | 659 | | | | |
| (6.000) | E Ink Holdings Inc | HSBC | (269) | | | | |
| (11.000) | E Ink Holdings Inc | JP Morgan | (3.400) | | | | |
| (582.495) | E.Sun Financial Holding Co Ltd | Citibank | 6.513 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|-------------|---|---------------------------|--|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| (12.000) | Far Eastern New Century Corp | Citibank | (77) | (5.000) | Fulgent Sun International Holding Co Ltd | Citibank | (1.270) |
| (281.000) | Far Eastern New Century Corp | JP Morgan | 1.888 | (11.000) | Fulgent Sun International Holding Co Ltd | JP Morgan | (1.768) |
| 1.000 | Far EasTone Telecommunications Co Ltd | Citibank | (56) | (6.000) | Gamania Digital Entertainment Co Ltd | Citibank | (698) |
| 1.000 | Far EasTone Telecommunications Co Ltd | HSBC | (71) | (13.000) | General Interface Solution Holding Ltd | Citibank | 1.111 |
| 37.000 | Far EasTone Telecommunications Co Ltd | JP Morgan | (2.677) | (1.000) | General Interface Solution Holding Ltd | HSBC | 136 |
| (29.000) | Farglory F T Z Investment Holding Co Ltd | Citibank | 4.260 | (6.000) | General Interface Solution Holding Ltd | JP Morgan | 824 |
| (11.000) | Farglory F T Z Investment Holding Co Ltd | JP Morgan | 2.865 | (1.000) | Genius Electronic Optical Co Ltd | JP Morgan | (778) |
| (19.000) | FDC International Hotels Corp | Citibank | (2.507) | 149.000 | Getac Holdings Corp | Citibank | 12.071 |
| (2.000) | FDC International Hotels Corp | JP Morgan | (667) | 13.000 | Getac Holdings Corp | HSBC | 3.236 |
| (9.000) | Feng Hsin Steel Co Ltd | Citibank | 92 | 122.000 | Getac Holdings Corp | JP Morgan | 29.480 |
| (17.000) | Feng Hsin Steel Co Ltd | JP Morgan | (337) | (1.000) | Giant Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | (666) |
| 47.640 | First Financial Holding Co Ltd | Citibank | 83 | 18.000 | Gigabyte Technology Co Ltd | Citibank | 14.488 |
| 16.320 | First Financial Holding Co Ltd | HSBC | 340 | 14.000 | Gigabyte Technology Co Ltd | HSBC | 23.331 |
| 17.460 | First Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 354 | 36.000 | Gigabyte Technology Co Ltd | JP Morgan | 59.887 |
| (5.000) | Fitipower Integrated Technology Inc | JP Morgan | (171) | 3.000 | Global Mixed Mode Technology Inc | Citibank | 161 |
| 1.000 | FLEXium Interconnect Inc | Citibank | 73 | 2.000 | Global Mixed Mode Technology Inc | HSBC | 232 |
| (7.000) | FLEXium Interconnect Inc | Citibank | (510) | 1.000 | Global PMX Co Ltd | JP Morgan | 35 |
| 23.000 | FocalTech Systems Co Ltd | Citibank | 2.893 | (10.000) | Global PMX Co Ltd | Citibank | (110) |
| 10.000 | FocalTech Systems Co Ltd | HSBC | 2.875 | (3.000) | Global PMX Co Ltd | JP Morgan | 97 |
| 1.000 | FocalTech Systems Co Ltd | JP Morgan | 286 | 1.000 | Global Unichip Corp | Citibank | 7.091 |
| (1.000) | Foresee Pharmaceuticals Co Ltd | HSBC | 162 | 1.000 | Global Unichip Corp | HSBC | 11.962 |
| (5.000) | Formosa Chemicals & Fibre Corp | Citibank | 279 | 2.000 | Global Unichip Corp | JP Morgan | 23.874 |
| (14.000) | Formosa Chemicals & Fibre Corp | HSBC | 68 | 3.000 | Globalwafers Co Ltd | Citibank | 2.070 |
| (2.000) | Formosa Chemicals & Fibre Corp | JP Morgan | 6 | 4.000 | Globalwafers Co Ltd | HSBC | 3.054 |
| (1.000) | Formosa Electronic Industries Inc | Citibank | 13 | 1.000 | Globalwafers Co Ltd | JP Morgan | 753 |
| 4.000 | Formosa International Hotels Corp | Citibank | 590 | (32.000) | Gold Circuit Electronics Ltd | Citibank | (8.655) |
| 1.000 | Formosa International Hotels Corp | HSBC | (102) | (16.000) | Gold Circuit Electronics Ltd | JP Morgan | (11.736) |
| 6.000 | Formosa International Hotels Corp | JP Morgan | (648) | (2.000) | Gold Rain Enterprises Corp | HSBC | (506) |
| (4.000) | Formosa Petrochemical Corp | Citibank | 332 | 16.000 | Goldsun Building Materials Co Ltd | Citibank | (233) |
| (84.000) | Formosa Petrochemical Corp | JP Morgan | (3.169) | 15.000 | Goldsun Building Materials Co Ltd | HSBC | (153) |
| (103.000) | Formosa Plastics Corp | Citibank | (1.838) | 37.000 | Goldsun Building Materials Co Ltd | JP Morgan | (400) |
| (31.000) | Formosa Plastics Corp | JP Morgan | (267) | 51.000 | Gourmet Master Co Ltd | Citibank | (21.192) |
| (77.000) | Formosa Taffeta Co Ltd | Citibank | 367 | 11.000 | Gourmet Master Co Ltd | HSBC | (2.555) |
| (3.000) | Formosa Taffeta Co Ltd | HSBC | (9) | 13.000 | Gourmet Master Co Ltd | JP Morgan | (2.947) |
| (131.000) | Formosa Taffeta Co Ltd | JP Morgan | (437) | (210.000) | Grand Pacific Petrochemical | Citibank | 1.243 |
| 1.000 | Foxsemicon Integrated Technology Inc | Citibank | 94 | (149.000) | Grand Pacific Petrochemical | JP Morgan | 3.909 |
| (115.000) | Froch Enterprise Co Ltd | Citibank | 328 | 16.000 | Grape King Bio Ltd | Citibank | (413) |
| (58.000) | Froch Enterprise Co Ltd | JP Morgan | (447) | 5.000 | Grape King Bio Ltd | HSBC | (1.856) |
| (1.000) | Fubon Financial Holding Co Ltd | Citibank | 33 | 18.000 | Grape King Bio Ltd | JP Morgan | (6.754) |
| (29.670) | Fubon Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (1.189) | (32.500) | Great Wall Enterprise Co Ltd | JP Morgan | 1.218 |
| | | | | 122.000 | Highwealth Construction Corp | Citibank | (281) |
| | | | | (32.000) | Highwealth Construction Corp | Citibank | 74 |
| | | | | 8.000 | Highwealth Construction Corp | HSBC | (207) |
| | | | | (1.000) | Highwealth Construction Corp | HSBC | (24) |
| | | | | 66.000 | Highwealth Construction Corp | JP Morgan | (1.768) |
| | | | | (21.000) | Highwealth Construction Corp | JP Morgan | (203) |
| | | | | 4.000 | Hiwin Technologies Corp | Citibank | (247) |
| | | | | 6.000 | Hiwin Technologies Corp | JP Morgan | 1.140 |
| | | | | (42.000) | Holtek Semiconductor Inc | Citibank | (2.715) |
| | | | | (2.000) | Holtek Semiconductor Inc | HSBC | (127) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------|---|-------------|---|-----------|-----------------------------------|-------------|---|
| | Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | |
| (19.000) | Holtek Semiconductor Inc | JP Morgan | (1.588) | 78.000 | Longchen Paper & Packaging Co Ltd | Citibank | (197) |
| (35.000) | Holy Stone Enterprise Co Ltd | Citibank | (943) | 8.000 | Longchen Paper & Packaging Co Ltd | HSBC | (127) |
| (23.000) | Holy Stone Enterprise Co Ltd | JP Morgan | (2.030) | 135.000 | Longchen Paper & Packaging Co Ltd | JP Morgan | (2.190) |
| (2.000) | Hota Industrial Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | (104) | (1.026) | Lotes Co Ltd | JP Morgan | 1.958 |
| (2.000) | Hotai Motor Co Ltd | Citibank | 2.173 | 1.000 | Lotus Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (569) |
| (9.000) | Hotai Motor Co Ltd | JP Morgan | (36.634) | 1.000 | M31 Technology Corp | Citibank | 6.995 |
| (21.000) | Hsin Kuang Steel Co Ltd | Citibank | (425) | 9.600 | Makalot Industrial Co Ltd | Citibank | (3.086) |
| (16.000) | Hsin Kuang Steel Co Ltd | JP Morgan | (713) | 1.300 | Makalot Industrial Co Ltd | HSBC | (571) |
| (2.000) | HTC Corp | Citibank | (91) | 20.251 | Makalot Industrial Co Ltd | JP Morgan | (9.000) |
| (34.000) | HTC Corp | JP Morgan | (4.688) | 24.000 | Marketech International Corp | Citibank | 2.567 |
| 22.120 | Hua Nan Financial Holdings Co Ltd | HSBC | 146 | 26.000 | Marketech International Corp | HSBC | 606 |
| 133.059 | Hua Nan Financial Holdings Co Ltd | JP Morgan | 812 | 4.000 | Marketech International Corp | JP Morgan | 82 |
| (300.579) | IBF Financial Holdings Co Ltd | Citibank | (777) | 1.000 | Materials Analysis Technology Inc | Citibank | 1.438 |
| (66.835) | IBF Financial Holdings Co Ltd | JP Morgan | (468) | 3.000 | Materials Analysis Technology Inc | HSBC | 4.681 |
| 2.000 | IEI Integration Corp | Citibank | (55) | 1.000 | MediaTek Inc | Citibank | 1.719 |
| 2.000 | IEI Integration Corp | HSBC | 548 | 1.000 | MediaTek Inc | HSBC | 2.686 |
| 7.000 | IEI Integration Corp | JP Morgan | 1.906 | 2.000 | MediaTek Inc | JP Morgan | 5.343 |
| 181.000 | Innolux Corp | Citibank | (726) | (2.050) | Mega Financial Holding Co Ltd | Citibank | 31 |
| 195.000 | Innolux Corp | HSBC | 2.989 | (99.425) | Mega Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (4.538) |
| 23.000 | Innolux Corp | JP Morgan | 346 | 4.540 | Mercuries Life Insurance Co Ltd | Citibank | 5 |
| (30.000) | International CSRC Investment Holdings Co | Citibank | 229 | 153.000 | Mercuries Life Insurance Co Ltd | HSBC | 692 |
| (102.000) | International CSRC Investment Holdings Co | HSBC | 1.477 | 139.391 | Mercuries Life Insurance Co Ltd | JP Morgan | 615 |
| (60.000) | International CSRC Investment Holdings Co | JP Morgan | 896 | (5.000) | Merida Industry Co Ltd | Citibank | (2.135) |
| 130.000 | Inventec Corp | Citibank | 26.439 | (2.000) | Microbio Co Ltd | Citibank | 26 |
| 12.000 | Inventec Corp | HSBC | 1.573 | (55.530) | Microbio Co Ltd | JP Morgan | 4.235 |
| 59.000 | Inventec Corp | JP Morgan | 7.694 | (27.000) | Micro-Star International Co Ltd | JP Morgan | (18.972) |
| 5.000 | ITE Technology Inc | Citibank | 185 | (61.000) | Mitac Holdings Corp | JP Morgan | (7.485) |
| 1.000 | ITE Technology Inc | HSBC | 69 | 1.000 | MSSCORPS Co Ltd | Citibank | 476 |
| (1.000) | Kaimei Electronic Corp | Citibank | 17 | 1.000 | MSSCORPS Co Ltd | HSBC | 305 |
| (1.000) | Kaimei Electronic Corp | JP Morgan | (10) | 12.000 | Nak Sealing Technologies Corp | Citibank | (805) |
| (81.000) | Kenda Rubber Industrial Co Ltd | Citibank | 1.191 | 10.000 | Nak Sealing Technologies Corp | HSBC | 2.557 |
| (88.000) | Kenda Rubber Industrial Co Ltd | JP Morgan | 2.979 | 2.000 | Nak Sealing Technologies Corp | JP Morgan | 493 |
| 102.000 | Kindom Development Co Ltd | Citibank | (163) | (102.000) | Nan Kang Rubber Tire Co Ltd | Citibank | 3.537 |
| 6.000 | Kindom Development Co Ltd | HSBC | (81) | (3.000) | Nan Kang Rubber Tire Co Ltd | HSBC | 91 |
| 58.000 | Kindom Development Co Ltd | JP Morgan | (821) | (77.000) | Nan Kang Rubber Tire Co Ltd | JP Morgan | 2.409 |
| 319.000 | King Yuan Electronics Co Ltd | Citibank | 73.940 | (149.000) | Nan Ya Plastics Corp | Citibank | 15.198 |
| 19.000 | King Yuan Electronics Co Ltd | HSBC | 5.009 | (67.000) | Nan Ya Plastics Corp | JP Morgan | 481 |
| 208.000 | King Yuan Electronics Co Ltd | JP Morgan | 54.627 | (3.000) | Nanya Technology Corp | JP Morgan | (831) |
| 29.000 | King's Town Bank Co Ltd | Citibank | (387) | (2.000) | Nien Made Enterprise Co Ltd | HSBC | (742) |
| 23.000 | King's Town Bank Co Ltd | HSBC | 242 | (8.000) | Nien Made Enterprise Co Ltd | JP Morgan | (784) |
| 30.000 | King's Town Bank Co Ltd | JP Morgan | 292 | 2.000 | Novatek Microelectronics Corp | JP Morgan | 1.248 |
| (225.000) | Kinpo Electronics | Citibank | (2.768) | (2.000) | OBI Pharma Inc | JP Morgan | 120 |
| (194.000) | Kinpo Electronics | JP Morgan | (3.238) | (4.000) | Oneness Biotech Co Ltd | JP Morgan | 1.260 |
| (1.000) | Kinsus Interconnect Technology Corp | Citibank | (173) | (10.000) | O-TA Precision Industry Co Ltd | Citibank | 5.203 |
| (12.000) | KMC Kuei Meng International Inc | Citibank | (883) | | | | |
| (4.000) | Laster Tech Corp Ltd | Citibank | 48 | | | | |
| (1.000) | Lien Hwa Industrial Holdings Corp | Citibank | 20 | | | | |
| (6.000) | Lite-On Technology Corp | JP Morgan | (1.449) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|-------------|---|---------------------------|--|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| (4.000) | O-TA Precision Industry Co Ltd | JP Morgan | 2.231 | (25.000) | Shinkong Synthetic Fibers Corp | HSBC | 356 |
| (4.000) | Pan Jit International Inc | HSBC | (398) | (225.000) | Shinkong Synthetic Fibers Corp | JP Morgan | 3.294 |
| (7.000) | Pan Jit International Inc | JP Morgan | (686) | (5.000) | Shiny Chemical Industrial Co Ltd | Citibank | (454) |
| (1.000) | Pan-International Industrial Corp | Citibank | (56) | (9.000) | Shiny Chemical Industrial Co Ltd | JP Morgan | (1.948) |
| (2.000) | PChome Online Inc | Citibank | 58 | (81.000) | Sigurd Microelectronics Corp | Citibank | (3.189) |
| (1.000) | PChome Online Inc | JP Morgan | 158 | (12.000) | Sigurd Microelectronics Corp | JP Morgan | (878) |
| 43.000 | Pegatron Corp | Citibank | 2.488 | 35.000 | Simplo Technology Co Ltd | Citibank | (587) |
| 1.000 | Pegatron Corp | HSBC | 158 | 3.000 | Simplo Technology Co Ltd | HSBC | (653) |
| 15.000 | Pegatron Corp | JP Morgan | 2.343 | 5.000 | Simplo Technology Co Ltd | JP Morgan | (1.122) |
| (6.000) | PharmaEngine Inc | JP Morgan | 1.363 | 16.000 | Sinbon Electronics Co Ltd | Citibank | 4.644 |
| 3.000 | Phison Electronics Corp | Citibank | 3.793 | 8.000 | Sinbon Electronics Co Ltd | HSBC | 2.797 |
| 6.000 | Phison Electronics Corp | HSBC | 6.712 | 6.000 | Sinbon Electronics Co Ltd | JP Morgan | 2.052 |
| 6.000 | Phison Electronics Corp | JP Morgan | 6.916 | 3.000 | Sino-American Silicon Products Inc | Citibank | 561 |
| 27.000 | Pixart Imaging Inc | Citibank | 719 | 1.000 | Sino-American Silicon Products Inc | HSBC | 136 |
| 12.000 | Pixart Imaging Inc | HSBC | 2.646 | 4.000 | Sino-American Silicon Products Inc | JP Morgan | 529 |
| 49.000 | Pixart Imaging Inc | JP Morgan | 9.959 | (273.795) | SinoPac Financial Holdings Co Ltd | JP Morgan | (456) |
| (2.000) | Polaris Group | Citibank | 36 | (110.000) | Solar Applied Materials Technology Corp | Citibank | 1.656 |
| (7.000) | Polaris Group | JP Morgan | 1.156 | (124.000) | Solar Applied Materials Technology Corp | JP Morgan | (2.204) |
| 19.000 | Pou Chen Corp | Citibank | (652) | (33.000) | Speed Tech Corp | Citibank | (138) |
| 1.000 | Pou Chen Corp | HSBC | (14) | (15.000) | Speed Tech Corp | JP Morgan | 460 |
| 37.000 | Pou Chen Corp | JP Morgan | (531) | 1.000 | Sporton International Inc | HSBC | (506) |
| (165.000) | Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp | JP Morgan | (2.760) | 5.000 | Standard Foods Corp | Citibank | (174) |
| 2.000 | Powertech Technology Inc | Citibank | 315 | 2.000 | Standard Foods Corp | HSBC | 14 |
| 2.000 | Powertech Technology Inc | HSBC | 338 | 4.000 | Standard Foods Corp | JP Morgan | 24 |
| 13.000 | Powertech Technology Inc | JP Morgan | 2.171 | (10.000) | Sunny Friend Environmental Technology Co Ltd | JP Morgan | 1.286 |
| 11.040 | Poya International Co Ltd | Citibank | (8.235) | 6.000 | Sunonwealth Electric Machine Industry Co Ltd | Citibank | 290 |
| 1.010 | Poya International Co Ltd | HSBC | (1.224) | (1.000) | Sunplus Technology Co Ltd | Citibank | (33) |
| 6.040 | Poya International Co Ltd | JP Morgan | (7.393) | (32.000) | Sunplus Technology Co Ltd | HSBC | (1.665) |
| 3.000 | President Chain Store Corp | JP Morgan | (665) | (20.000) | Sunplus Technology Co Ltd | JP Morgan | (1.030) |
| 52.000 | Primax Electronics Ltd | Citibank | 2.361 | (504) | Supreme Electronics Co Ltd (Pref) | JP Morgan | 4 |
| 11.000 | Primax Electronics Ltd | HSBC | 1.026 | (28.000) | Synnex Technology International Corp | Citibank | 1.466 |
| 24.000 | Primax Electronics Ltd | JP Morgan | 2.206 | (101.000) | Synnex Technology International Corp | JP Morgan | (684) |
| 23.000 | Qisda Corp | HSBC | 5.895 | 2.000 | Systex Corp | JP Morgan | 92 |
| 11.000 | Qisda Corp | JP Morgan | 2.811 | (12.000) | T3EX Global Holdings Corp | Citibank | 2.588 |
| 20.000 | Quanta Computer Inc | Citibank | 6.720 | (23.000) | T3EX Global Holdings Corp | JP Morgan | 4.127 |
| 22.000 | Quanta Computer Inc | HSBC | 18.546 | (25.000) | TA Chen Stainless Pipe | Citibank | 387 |
| 72.000 | Quanta Computer Inc | JP Morgan | 42.648 | (73.000) | TA Chen Stainless Pipe | JP Morgan | 1.138 |
| (2.000) | Raydium Semiconductor Corp | Citibank | (386) | (53.860) | Ta Ya Electric Wire & Cable | Citibank | 1.320 |
| (1.000) | Raydium Semiconductor Corp | JP Morgan | 1.044 | (60.020) | Ta Ya Electric Wire & Cable | JP Morgan | 1.935 |
| (1.000) | RDC Semiconductor Co Ltd | JP Morgan | 146 | (14.000) | Taichung Commercial Bank Co Ltd | JP Morgan | 19 |
| 3.000 | Realtek Semiconductor Corp | Citibank | 734 | (1.000) | TaiDoc Technology Corp | Citibank | (65) |
| 2.000 | Realtek Semiconductor Corp | HSBC | 794 | 9.000 | Taigen Biopharmaceuticals Holdings Ltd | Citibank | (66) |
| 2.000 | Realtek Semiconductor Corp | JP Morgan | 778 | 3.000 | Taigen Biopharmaceuticals Holdings Ltd | JP Morgan | (43) |
| 1.000 | RichWave Technology Corp | Citibank | 72 | (59.000) | Tainan Spinning Co Ltd | Citibank | 244 |
| 82.000 | Roo Hsing Co Ltd* | Citibank | (1.571) | (99.000) | Tainan Spinning Co Ltd | JP Morgan | 2.248 |
| 5.000 | Roo Hsing Co Ltd* | HSBC | (96) | (5.000) | Taishin Financial Holding Co Ltd | Citibank | 38 |
| 8.000 | Roo Hsing Co Ltd* | JP Morgan | (154) | (174.445) | Taishin Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | (1.982) |
| (4.000) | San Fu Chemical Co Ltd | HSBC | (420) | | | | |
| 40.000 | Sercomm Corp | Citibank | 7.356 | | | | |
| 17.000 | Sercomm Corp | HSBC | 3.822 | | | | |
| 28.000 | Sercomm Corp | JP Morgan | 6.240 | | | | |
| (27.000) | Sesoda Corp | JP Morgan | 3.044 | | | | |
| (17.172) | Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd | Citibank | 1.357 | | | | |
| (151.315) | Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd | JP Morgan | 6.557 | | | | |
| (177.000) | Shin Kong Financial Holding Co Ltd | HSBC | (1.047) | | | | |
| (3.000) | Shinfox Energy Co Ltd | Citibank | 213 | | | | |
| (53.000) | Shinkong Synthetic Fibers Corp | Citibank | 49 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|---|-------------|---|---------------------------|---|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Taiwan Fortsetzung | | | |
| (20.000) | Taisun Enterprise Co Ltd | Citibank | (813) | (28.000) | TSRC Corp | JP Morgan | 1.528 |
| 127.210 | Taiwan Cogeneration Corp | Citibank | 3.488 | 1.000 | TTY Biopharm Co Ltd | Citibank | (17) |
| 27.074 | Taiwan Cogeneration Corp | HSBC | 1.697 | 1.000 | TTY Biopharm Co Ltd | HSBC | (44) |
| 4.543 | Taiwan Cogeneration Corp | JP Morgan | 182 | 29.000 | TTY Biopharm Co Ltd | JP Morgan | (1.338) |
| (1.000) | Taiwan Fertilizer Co Ltd | HSBC | 11 | 29.000 | Tung Ho Steel Enterprise Corp | Citibank | (1.506) |
| (1.000) | Taiwan Fertilizer Co Ltd | JP Morgan | 12 | 8.000 | Tung Ho Steel Enterprise Corp | HSBC | (293) |
| 10.000 | Taiwan Glass Industry Corp | Citibank | (238) | 12.000 | Tung Ho Steel Enterprise Corp | JP Morgan | (454) |
| 11.000 | Taiwan Glass Industry Corp | HSBC | (265) | (5.000) | TXC Corp | Citibank | (497) |
| 33.000 | Taiwan Glass Industry Corp | JP Morgan | (810) | (14.000) | TXC Corp | HSBC | (1.418) |
| 119.000 | Taiwan High Speed Rail Corp | Citibank | (1.761) | (63.000) | TXC Corp | JP Morgan | (6.305) |
| 188.000 | Taiwan High Speed Rail Corp | HSBC | 7.539 | (4.458) | U-MEDIA Communications Inc | Citibank | (319) |
| 133.000 | Taiwan High Speed Rail Corp | JP Morgan | 5.276 | (1.114) | U-MEDIA Communications Inc | JP Morgan | (12) |
| (1.000) | Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd | JP Morgan | (7) | (17.000) | U-Ming Marine Transport Corp | JP Morgan | 2.406 |
| (32.000) | Taiwan Mask Corp | Citibank | (798) | (36.000) | Unimicron Technology Corp | JP Morgan | (22.310) |
| (2.000) | Taiwan Mask Corp | HSBC | (73) | (42.991) | Uni-Bank Of Taiwan | JP Morgan | (706) |
| (13.000) | Taiwan Mask Corp | JP Morgan | (412) | 25.000 | Uni-President Enterprises Corp | Citibank | (1.241) |
| 6.000 | Taiwan Mobile Co Ltd | Citibank | (131) | 34.000 | Uni-President Enterprises Corp | HSBC | (289) |
| (18.000) | Taiwan Navigation Co Ltd | JP Morgan | 665 | 1.000 | Uni-President Enterprises Corp | JP Morgan | (10) |
| (2.000) | Taiwan Paiho Ltd | Citibank | (7) | 2.000 | United Integrated Services Co Ltd | Citibank | 562 |
| (3.000) | Taiwan Paiho Ltd | JP Morgan | 14 | 1.000 | United Integrated Services Co Ltd | HSBC | 180 |
| 4.000 | Taiwan Secom Co Ltd | Citibank | 431 | 1.000 | United Integrated Services Co Ltd | JP Morgan | 175 |
| 20.000 | Taiwan Secom Co Ltd | HSBC | 3.748 | 31.000 | United Microelectronics Corp | Citibank | 2.844 |
| 17.000 | Taiwan Secom Co Ltd | JP Morgan | 1.694 | 44.000 | United Microelectronics Corp | HSBC | 2.422 |
| 1.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | JP Morgan | 1.711 | 13.000 | United Microelectronics Corp | JP Morgan | 701 |
| (6.000) | Taiwan Surface Mounting Technology Corp | Citibank | (476) | 2.000 | United Orthopedic Corp | HSBC | 356 |
| (11.000) | Taiwan Surface Mounting Technology Corp | JP Morgan | (1.379) | 3.000 | United Orthopedic Corp | JP Morgan | 530 |
| (13.000) | Taiwan TEA Corp | JP Morgan | 663 | (96.000) | United Renewable Energy Co Ltd | Citibank | (365) |
| 17.000 | Taiwan Union Technology Corp | Citibank | 1.427 | (17.000) | United Renewable Energy Co Ltd | JP Morgan | 247 |
| 1.000 | Taiwan Union Technology Corp | HSBC | 233 | (3.000) | Universal Microwave Technology Inc | JP Morgan | (735) |
| 42.000 | Taiwan Union Technology Corp | JP Morgan | 9.715 | 2.050 | Universal Vision | Citibank | (178) |
| (18.000) | Taiwan-Asia Semiconductor Corp | Citibank | (492) | 8.100 | Universal Vision Biotechnology Co Ltd | HSBC | (2.735) |
| (4.000) | Taiwan-Asia Semiconductor Corp | JP Morgan | (208) | 7.000 | Universal Vision Biotechnology Co Ltd | JP Morgan | (2.426) |
| (1.000) | Tatung Co Ltd | Citibank | (127) | 40.000 | UPC Technology Corp | Citibank | (357) |
| (89.000) | Tatung Co Ltd | JP Morgan | (22.744) | (53.000) | USI Corp | Citibank | 1.275 |
| 28.000 | Teco Electric and Machinery Co Ltd | Citibank | (716) | (39.000) | USI Corp | JP Morgan | 1.674 |
| 20.000 | Teco Electric and Machinery Co Ltd | HSBC | 1.558 | 10.000 | Vanguard International Semiconductor Corp | Citibank | 618 |
| 74.000 | Teco Electric and Machinery Co Ltd | JP Morgan | 3.031 | 6.000 | Vanguard International Semiconductor Corp | HSBC | 501 |
| 59.000 | Ton Yi Industrial Corp | Citibank | (542) | (1.000) | Via Technologies Inc | JP Morgan | 2.130 |
| 2.000 | Ton Yi Industrial Corp | HSBC | (84) | (19.000) | Via Technologies Inc | Citibank | (116) |
| 9.000 | Ton Yi Industrial Corp | JP Morgan | (383) | (2.000) | Visual Photonics Epitaxy Co Ltd | JP Morgan | (3.579) |
| (5.400) | Tong Hsing Electronic Industries Ltd | Citibank | (1.179) | (7.000) | Visual Photonics Epitaxy Co Ltd | Citibank | (491) |
| 76.000 | Tong Yang Industry Co Ltd | Citibank | (4.167) | (11.000) | Wafer Works Corp | JP Morgan | (1.235) |
| 6.000 | Tong Yang Industry Co Ltd | HSBC | 116 | | | Citibank | (422) |
| 79.000 | Tong Yang Industry Co Ltd | JP Morgan | 1.444 | | | | |
| 14.000 | TPK Holding Co Ltd | Citibank | 333 | | | | |
| 4.000 | TPK Holding Co Ltd | HSBC | 506 | | | | |
| 5.000 | TPK Holding Co Ltd | JP Morgan | 576 | | | | |
| (48.000) | Transcend Information Inc | Citibank | (5.902) | | | | |
| (20.000) | Transcend Information Inc | JP Morgan | (3.839) | | | | |
| (21.000) | Tripod Technology Corp | Citibank | (1.908) | | | | |
| (49.000) | Tripod Technology Corp | JP Morgan | (17.009) | | | | |
| (83.086) | TSEC Corp | Citibank | (1.058) | | | | |
| (65.198) | TSEC Corp | HSBC | 377 | | | | |
| (16.775) | TSEC Corp | JP Morgan | 110 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|---|-------------|---|-----------------------------|--|-------------|---|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Thailand Fortsetzung | | | |
| (7.000) | Wafer Works Corp | HSBC | (240) | 2.300 | Amata Corp PCL | Citibank | 20 |
| (26.000) | Wafer Works Corp | JP Morgan | (868) | 2.300 | Amata Corp PCL | HSBC | (122) |
| (92.679) | Walsin Lihwa Corp | JP Morgan | 4.933 | 5.700 | AP Thailand PCL | JP Morgan | (227) |
| (34.000) | Wan Hai Lines Ltd | Citibank | 2.545 | (1.400) | B Grimm Power PCL | Citibank | 4 |
| (13.000) | Wan Hai Lines Ltd | JP Morgan | 664 | 72.900 | Bangchak Corp PCL | Citibank | 1.497 |
| 4.000 | Win Semiconductors Corp | HSBC | (958) | 2.100 | Bangchak Corp PCL | HSBC | 51 |
| (15.000) | Winbond Electronics Corp | Citibank | (394) | 231.100 | Bangchak Corp PCL | JP Morgan | 7.061 |
| (264.000) | Winbond Electronics Corp | JP Morgan | (17.874) | (165.800) | Bangkok Chain Hospital PCL | Citibank | (3.516) |
| (9.000) | Wisdom Marine Lines Co Ltd | Citibank | 3.634 | 38.200 | Bangkok Chain Hospital PCL | Citibank | 810 |
| (12.000) | Wisdom Marine Lines Co Ltd | HSBC | 3.957 | (16.100) | Bangkok Chain Hospital PCL | JP Morgan | 1.141 |
| (25.000) | Wisdom Marine Lines Co Ltd | JP Morgan | 8.277 | 800 | Bangkok Chain Hospital PCL | JP Morgan | (66) |
| 189.000 | Wistron Corp | Citibank | 85.573 | 21.500 | Bangkok Dusit Medical Services PCL 'F' | Citibank | (161) |
| 41.000 | Wistron Corp | HSBC | 22.272 | 59.100 | Bangkok Expressway & Metro PCL | Citibank | (640) |
| 216.000 | Wistron Corp | JP Morgan | 117.100 | 24.200 | Bangkok Expressway & Metro PCL | JP Morgan | (732) |
| 60.000 | Wistron NeWeb Corp | Citibank | 4.215 | 16.300 | Bangkok Ranch PCL | Citibank | 63 |
| 15.000 | Wistron NeWeb Corp | HSBC | (4.641) | (490.000) | BEC World PCL | Citibank | (2.399) |
| 43.000 | Wistron NeWeb Corp | JP Morgan | (13.679) | (9.700) | BEC World PCL | JP Morgan | (286) |
| 12.000 | Wowprime Corp | Citibank | 5.651 | 15.600 | Berli Jucker PCL | Citibank | (715) |
| 1.000 | Wowprime Corp | HSBC | 25 | 4.900 | Berli Jucker PCL | HSBC | (551) |
| 4.000 | Wowprime Corp | JP Morgan | 73 | 800 | Berli Jucker PCL | JP Morgan | (84) |
| (15.000) | WPG Holdings Ltd | Citibank | (201) | (96.700) | BTS Group Holdings PCL | Citibank | 883 |
| (4.000) | WPG Holdings Ltd | JP Morgan | (372) | (136.900) | BTS Group Holdings PCL | JP Morgan | 3.249 |
| (36.000) | WT Microelectronics Co Ltd | Citibank | 1.047 | 4.300 | Bumrungrad Hospital PCL | Citibank | (1.501) |
| (1.000) | WT Microelectronics Co Ltd | HSBC | (25) | 200 | Bumrungrad Hospital PCL | HSBC | (204) |
| (20.000) | WT Microelectronics Co Ltd | JP Morgan | (466) | 6.700 | Bumrungrad Hospital PCL | JP Morgan | (6.488) |
| (3.000) | XinTec Inc | HSBC | (467) | (2.900) | Carabao Group PCL 'F' | Citibank | 261 |
| (7.000) | XinTec Inc | JP Morgan | (1.081) | 5.100 | Central Pattana PCL | Citibank | (128) |
| (8.298) | Yageo Corp | JP Morgan | (694) | 13.500 | Central Pattana PCL | HSBC | (2.379) |
| (1.000) | Yang Ming Marine Transport Corp | Citibank | 46 | 700 | Central Pattana PCL | JP Morgan | (113) |
| (57.000) | Yang Ming Marine Transport Corp | JP Morgan | (307) | 1.900 | Central Plaza Hotel PCL | HSBC | (405) |
| (53.000) | YC INOX Co Ltd | Citibank | 169 | 18.300 | Central Plaza Hotel PCL | JP Morgan | (3.558) |
| (76.000) | YC INOX Co Ltd | JP Morgan | 1.024 | (48.400) | Central Retail Corp PCL | Citibank | (45.851) |
| 1.000 | Yeong Guan Energy Technology Group Co Ltd | Citibank | (359) | (21.800) | Central Retail Corp PCL | JP Morgan | 2.840 |
| 8.000 | Yeong Guan Energy Technology Group Co Ltd | HSBC | (2.729) | (135.500) | Charoen Pokphand Foods PCL | Citibank | (66) |
| 1.000 | Yeong Guan Energy Technology Group Co Ltd | JP Morgan | (343) | (76.500) | Charoen Pokphand Foods PCL | JP Morgan | (952) |
| (9.000) | YFY Inc | JP Morgan | 41 | (8.200) | CK Power PCL | Citibank | 31 |
| 70.000 | Yieh Phui Enterprise Co Ltd | JP Morgan | 471 | (64.200) | CK Power PCL | JP Morgan | 1.007 |
| 15.000 | Yuanta Financial Holding Co Ltd | HSBC | 391 | (138.700) | CP ALL PCL | Citibank | (4.700) |
| 12.000 | Yuanta Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 306 | (1.800) | CP ALL PCL | JP Morgan | 141 |
| 5.264 | Yulon Finance Corp | Citibank | (313) | (3.000) | Delta Electronics Thailand PCL | Citibank | (509) |
| 505 | Yulon Finance Corp | HSBC | 34 | (8.000) | Delta Electronics Thailand PCL | HSBC | (3.879) |
| 2.759 | Yulon Finance Corp | JP Morgan | 175 | (18.000) | Delta Electronics Thailand PCL | JP Morgan | (3.927) |
| (16.000) | Yulon Motor Co Ltd | JP Morgan | (4.831) | 625.500 | Erawan Group PCL | Citibank | (5.401) |
| (56.000) | Zhen Ding Technology Holding Ltd | HSBC | (10.333) | 140.000 | Erawan Group PCL | HSBC | (3.728) |
| (15.000) | Zhen Ding Technology Holding Ltd | JP Morgan | (646) | 227.900 | Erawan Group PCL | JP Morgan | (5.840) |
| | | | 636.684 | (134.600) | Esso Thailand PCL | Citibank | 1.089 |
| 33.500 | AAPICO Hitech PCL | HSBC | 4.121 | (31.300) | Hana Microelectronics PCL | Citibank | (2.132) |
| 12.900 | AAPICO Hitech PCL | JP Morgan | 5.123 | (8.700) | Hana Microelectronics PCL | JP Morgan | (6) |
| (3.200) | Advanced Info Service PCL | Citibank | 271 | 230.100 | Home Product Center PCL | Citibank | (3.509) |
| (14.200) | Advanced Info Service PCL | JP Morgan | 5.293 | 175.500 | Home Product Center PCL | HSBC | (5.710) |
| 54.100 | Airports of Thailand PCL | Citibank | (2.974) | 182.000 | Home Product Center PCL | JP Morgan | (5.382) |
| 58.900 | Airports of Thailand PCL | HSBC | (8.799) | 55.500 | Indorama Ventures PCL | Citibank | (2.478) |
| 65.200 | Airports of Thailand PCL | JP Morgan | (8.758) | 42.700 | Indorama Ventures PCL | HSBC | (4.005) |
| | | | | 58.500 | Indorama Ventures PCL | JP Morgan | (5.080) |
| | | | | (43.600) | Intouch Holdings PCL 'F' | Citibank | (1.350) |
| | | | | (52.600) | Intouch Holdings PCL 'F' | HSBC | 6.871 |
| | | | | (34.600) | Intouch Holdings PCL 'F' | JP Morgan | 3.975 |
| | | | | (1.718.100) | IRPC PCL | Citibank | 4.995 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-------------|---|-----------------------------|---|-------------|---|
| Thailand Fortsetzung | | | | Thailand Fortsetzung | | | |
| (118.700) | IRPC PCL | JP Morgan | 730 | 94.100 | Tisco Financial Group PCL | JP Morgan | 7.212 |
| (78.900) | KCE Electronics PCL | Citibank | (1.474) | 385.800 | TMBThanachart Bank PCL | Citibank | 734 |
| (2.600) | KCE Electronics PCL | JP Morgan | 180 | 1.145.000 | TMBThanachart Bank PCL | JP Morgan | 1.512 |
| 558 | Kiatnakin Phatra Bank PCL | Citibank | 38 | (907.471) | True Corp PCL | Citibank | 33.225 |
| 558 | Kiatnakin Phatra Bank PCL | Citibank | 68 | 38.400 | TTW PCL | Citibank | (86) |
| 2.391 | Kiatnakin Phatra Bank PCL | JP Morgan | 161 | 76.500 | TTW PCL | HSBC | (897) |
| 2.391 | Kiatnakin Phatra Bank PCL | JP Morgan | 293 | 10.100 | TTW PCL | JP Morgan | (100) |
| (146.000) | Krung Thai Bank PCL | Citibank | (536) | | | | |
| 343.900 | Land & Houses PCL Reg | Citibank | (2.768) | | | | |
| 427.600 | Land & Houses PCL Reg | HSBC | (15.767) | | | | |
| 402.200 | Land & Houses PCL Reg | JP Morgan | (14.050) | 86 | Atour Lifestyle Holdings Ltd ADR | JP Morgan | (67) |
| (371.100) | Major Cineplex Group PCL | Citibank | (9.240) | 251 | Autohome Inc ADR | Citibank | (489) |
| (23.300) | Major Cineplex Group PCL | JP Morgan | 3.317 | 930 | Autohome Inc ADR | JP Morgan | (1.488) |
| (36.300) | MBK PCL | Citibank | (581) | 9.285 | Baozun Inc ADR | Citibank | (5.014) |
| (2.200) | MBK PCL | JP Morgan | 579 | 8.342 | Baozun Inc ADR | HSBC | (3.757) |
| 68.000 | Minor International PCL | Citibank | 379 | 3.496 | Baozun Inc ADR | JP Morgan | (2.517) |
| (400) | Minor International PCL | HSBC | (2) | (175) | BeiGene Ltd ADR | Citibank | 3.462 |
| 64.119 | Minor International PCL | HSBC | (1.380) | (10.000) | China State Construction International Holdings Ltd | Citibank | 839 |
| (43) | Minor International PCL [†] | JP Morgan | — | (2.539) | Chindata Group Holdings Ltd ADR | Citibank | (876) |
| 17.100 | Minor International PCL | JP Morgan | (251) | (2.658) | Chindata Group Holdings Ltd ADR | HSBC | 1.435 |
| 90.865 | Ngern Tid Lor PCL | JP Morgan | 10.772 | (277) | Chindata Group Holdings Ltd ADR | JP Morgan | 150 |
| 4.100 | Osotspa PCL | Citibank | (180) | 792 | Chunghwa Telecom Co Ltd ADR | JP Morgan | (400) |
| 3.500 | Osotspa PCL | HSBC | (165) | (570) | Dada Nexus Ltd ADR | Citibank | 638 |
| 5.600 | Osotspa PCL | JP Morgan | (229) | 199 | Dada Nexus Ltd ADR | HSBC | (245) |
| (98.500) | Precious Shipping PCL | Citibank | 3.528 | (617) | Dada Nexus Ltd ADR | HSBC | 759 |
| (74.500) | Precious Shipping PCL | JP Morgan | 5.818 | 686 | Dada Nexus Ltd ADR | JP Morgan | (844) |
| (20.100) | PTT Global Chemical PCL | Citibank | 1.499 | (350) | Daqo New Energy Corp ADR | HSBC | 2.618 |
| (66.600) | PTT Global Chemical PCL | JP Morgan | 15.232 | (1.643) | FinVolution Group ADR | HSBC | 320 |
| (2.500) | PTT Oil & Retail Business PCL | Citibank | 176 | 1.072 | Full Truck Alliance Co Ltd ADR | HSBC | 11 |
| (6.200) | PTT Oil & Retail Business PCL | HSBC | 547 | 796 | Full Truck Alliance Co Ltd ADR | JP Morgan | 8 |
| (25.700) | Ratch Group PCL | Citibank | 433 | 1.059 | Genpact Ltd | Citibank | (1.419) |
| (73.200) | Regional Container Lines PCL | Citibank | 7.895 | 3.367 | Genpact Ltd | JP Morgan | (8.822) |
| (37.200) | Regional Container Lines PCL | JP Morgan | 692 | 393 | Gogoro Inc | JP Morgan | (86) |
| 1.944.300 | Sansiri PCL | Citibank | (2.587) | 9.847 | Grab Holdings Ltd 'A' | Citibank | (1.132) |
| 1.354.300 | Sansiri PCL | HSBC | (8.831) | 12.119 | Grab Holdings Ltd 'A' | HSBC | (4.787) |
| 1.738.100 | Sansiri PCL | JP Morgan | (10.738) | 15.976 | Grab Holdings Ltd 'A' | JP Morgan | (3.995) |
| (17.400) | SCB X PCL | JP Morgan | 2.198 | 904 | H World Group Ltd ADR | Citibank | (5.451) |
| (44.000) | Siam Cement PCL Reg | Citibank | 25.406 | 23 | HDFC Bank Ltd ADR | Citibank | (17) |
| (400) | Siam Cement PCL Reg | HSBC | 299 | 1.592 | Hello Group Inc ADR | Citibank | (1.083) |
| (2.200) | Siam Cement PCL Reg | JP Morgan | 1.492 | 1.585 | Hello Group Inc ADR | HSBC | (380) |
| (3.100) | Singer Thailand PCL Reg | JP Morgan | 151 | 5.009 | Hello Group Inc ADR | JP Morgan | (1.203) |
| 53.600 | Sino-Thai Engineering & Construction PCL | Citibank | (366) | 9.663 | Himax Technologies Inc ADR | Citibank | 242 |
| 103.700 | Sino-Thai Engineering & Construction PCL | HSBC | (8.349) | 2.782 | Himax Technologies Inc ADR | HSBC | 264 |
| 101.600 | Sino-Thai Engineering & Construction PCL | JP Morgan | (7.935) | 10.739 | Himax Technologies Inc ADR | JP Morgan | 1.020 |
| (240.700) | Sri Trang Agro-Industry PCL | Citibank | (186) | 1.362 | HUTCHMED China Ltd ADR | Citibank | (1.471) |
| (43.300) | Sri Trang Agro-Industry PCL | JP Morgan | 1.936 | 205 | HUTCHMED China Ltd ADR | HSBC | (720) |
| (400) | Srisawad Corp PCL | Citibank | (26) | 1.293 | HUTCHMED China Ltd ADR | JP Morgan | (4.538) |
| (1.600) | Srisawad Corp PCL | JP Morgan | 188 | 5.714 | HUYA Inc ADR | Citibank | (2.171) |
| 135.800 | Supalai PCL | Citibank | (1.119) | 4.605 | HUYA Inc ADR | HSBC | (1.194) |
| 155.100 | Supalai PCL | HSBC | (5.897) | 4.290 | HUYA Inc ADR | JP Morgan | (944) |
| 395.600 | Supalai PCL | JP Morgan | (13.351) | 12.776 | ICICI Bank Ltd ADR | Citibank | (348) |
| (21.900) | Thai Life Insurance PCL | Citibank | 1.088 | 14.055 | ICICI Bank Ltd ADR | JP Morgan | (1.163) |
| (11.200) | Thai Oil PCL | Citibank | 859 | 631 | I-Mab ADR | Citibank | (50) |
| (41.800) | Thai Oil PCL | JP Morgan | 6.400 | 473 | I-Mab ADR | HSBC | 95 |
| (127.910) | Thai Vegetable Oil PCL | Citibank | (56) | 4.176 | I-Mab ADR | JP Morgan | 796 |
| 17.600 | Thanachart Capital PCL | JP Morgan | 667 | (12.317) | Infosys Ltd ADR | Citibank | (4.249) |
| (218.800) | Thoresen Thai Agencies PCL | Citibank | 97 | (4.338) | Infosys Ltd ADR | HSBC | (3.188) |
| (11.400) | Thoresen Thai Agencies PCL | JP Morgan | 46 | (527) | Infosys Ltd ADR | JP Morgan | (367) |
| 50.600 | Tisco Financial Group PCL | Citibank | 542 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------|--|---|------------------------|-------------|--|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 2.614 | iQIYI Inc ADR | Citibank | (2.078) | 207 | WNS Holdings Ltd ADR | JP Morgan | 1.732 |
| 266 | iQIYI Inc ADR | JP Morgan | (477) | 248 | Yum China Holdings Inc | HSBC | (1.549) |
| 937 | JOYY Inc ADR | Citibank | (2.670) | 334 | Zai Lab Ltd ADR | Citibank | (414) |
| 205 | JOYY Inc ADR | HSBC | (684) | 125 | Zai Lab Ltd ADR | JP Morgan | (168) |
| 218 | JOYY Inc ADR | JP Morgan | (846) | | | | (92.767) |
| 790 | Kanzhun Ltd ADR | Citibank | (3.188) | | | | |
| 1.904 | KE Holdings Inc ADR | Citibank | (2.110) | | | | |
| 1.292 | KE Holdings Inc ADR | HSBC | (2.035) | | | | |
| 80 | KE Holdings Inc ADR | JP Morgan | (139) | | | | |
| (126) | Legend Biotech Corp ADR | Citibank | (62) | | | | |
| 2.796 | Lufax Holding Ltd ADR | HSBC | (1.230) | | | | |
| 11.342 | Lufax Holding Ltd ADR | JP Morgan | (1.159) | | | | |
| 488 | MakeMyTrip Ltd | Citibank | (322) | | | | |
| 742 | MakeMyTrip Ltd | HSBC | 237 | | | | |
| 1.162 | MakeMyTrip Ltd | JP Morgan | 372 | | | | |
| 977 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | Citibank | (463) | | | | |
| 2.113 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | HSBC | (4.395) | | | | |
| 1.898 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | JP Morgan | (2.856) | | | | |
| 410 | MINISO Group Holding Ltd ADR | HSBC | (623) | | | | |
| 3 | Missfresh Ltd ADR ^{**} | HSBC | — | | | | |
| 1.160 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | Citibank | (673) | | | | |
| 165 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | HSBC | (738) | | | | |
| 189 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | JP Morgan | (112) | | | | |
| 924 | NIO Inc ADR | HSBC | (818) | | | | |
| 3.548 | NIO Inc ADR | JP Morgan | (3.583) | | | | |
| (1.323) | Noah Holdings Ltd ADR | Citibank | 66 | | | | |
| (893) | Noah Holdings Ltd ADR | HSBC | (510) | | | | |
| (86) | Noah Holdings Ltd ADR | JP Morgan | (57) | | | | |
| 57 | PDD Holdings Inc ADR | Citibank | 43 | | | | |
| 119 | PDD Holdings Inc ADR | HSBC | 219 | | | | |
| 128 | PDD Holdings Inc ADR | JP Morgan | 236 | | | | |
| 505 | Qifu Technology Inc ADR | Citibank | (730) | | | | |
| 268 | Qifu Technology Inc ADR | HSBC | (1.163) | | | | |
| 231 | Qifu Technology Inc ADR | JP Morgan | (125) | | | | |
| (5.045) | ReNew Energy Global Plc 'A' | JP Morgan | (1.312) | | | | |
| 516 | Silicon Motion Technology Corp ADR | HSBC | 1.743 | | | | |
| 1.180 | SK Telecom Co Ltd ADR | Citibank | (71) | | | | |
| 1.762 | SK Telecom Co Ltd ADR | HSBC | 423 | | | | |
| 5.902 | SK Telecom Co Ltd ADR | JP Morgan | 1.416 | | | | |
| 829 | Sohu.com Ltd ADR | HSBC | (1.923) | | | | |
| 361 | Sohu.com Ltd ADR | JP Morgan | (838) | | | | |
| 390 | TAL Education Group ADR | HSBC | (37) | | | | |
| 947 | TAL Education Group ADR | JP Morgan | (90) | | | | |
| (810) | TDCX Inc ADR | Citibank | (275) | | | | |
| (2.621) | TDCX Inc ADR | HSBC | (1.101) | | | | |
| (2.055) | TDCX Inc ADR | JP Morgan | (863) | | | | |
| 152 | Tencent Music Entertainment Group ADR | Citibank | (114) | | | | |
| 278 | Tencent Music Entertainment Group ADR | JP Morgan | (117) | | | | |
| 972 | Trip.com Group Ltd ADR | HSBC | (1.030) | | | | |
| 1.995 | Trip.com Group Ltd ADR | JP Morgan | (2.115) | | | | |
| 11.164 | Vnet Group Inc ADR | Citibank | (2.679) | | | | |
| 2.446 | Vnet Group Inc ADR | HSBC | (1.003) | | | | |
| 182 | WNS Holdings Ltd ADR | Citibank | 503 | | | | |
| 236 | WNS Holdings Ltd ADR | HSBC | 1.606 | | | | |
| | | | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 207.498.129) | | | |
| | | | | 101.077 | | | |

^{*} Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a).

^{**} Beträge mit einem Wert unter USD 0,5 wurden auf null abgerundet.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (86) | USD | MSCI China A 50 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 4.289.250 | 288.280 |
| (14) | USD | MSCI India Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.307.600 | (90.030) |
| Gesamt | | | | | 198.250 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISETERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 4.083.015 | USD | 4.495.976 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (133.056) |
| USD | 45.167 | EUR | 41.843 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 456 |
| | | | | | | (132.600) |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 8.548.550 | USD | 10.829.679 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (244.501) |
| USD | 963.038 | GBP | 773.775 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 4.917 |
| | | | | | | (239.584) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 15.950.930) | | | | | | (372.184) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 45,81 |
| Finanzen | 36,18 |
| Industrie | 4,99 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 4,52 |
| Zyklische Konsumgüter | 2,46 |
| Kommunikation | 1,71 |
| Grundstoffe | 1,22 |
| Versorger | 1,15 |
| Energie | 0,23 |
| Technologie | 0,10 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,37 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,63 |
| | 100,00 |

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|-------------------------------------|------------------------|--------------------|---------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Finnland | | | |
| STAMMAKTIE | | | | 20.521 | Neste Oyj | 725.828 | 0,09 |
| | | | | 25.294 | Stora Enso Oyj 'R' | 299.607 | 0,04 |
| | | | | 14.037 | UPM-Kymmene Oyj | 394.019 | 0,05 |
| | | | | | | 1.419.454 | 0,18 |
| | | | | Frankreich | | | |
| Australien | | | | 2.666 | Aeroports de Paris | 378.839 | 0,05 |
| 46.159 | Costa Group Holdings Ltd | 74.252 | 0,01 | 1.480 | Air Liquide SA* | 231.827 | 0,03 |
| 26.800 | National Australia Bank Ltd* | 422.488 | 0,05 | 7.020 | Cie de Saint-Gobain | 363.636 | 0,05 |
| 33.971 | NEXTDC Ltd | 262.096 | 0,03 | 4.139 | Edenred | 248.671 | 0,03 |
| 132.089 | Santos Ltd | 584.522 | 0,08 | 15.911 | Getlink SE | 252.667 | 0,03 |
| 53.644 | Transurban Group (Unit) | 483.239 | 0,06 | 1.387 | Hermes International | 2.637.796 | 0,34 |
| 7.618 | Woodside Energy Group Ltd* | 158.614 | 0,02 | 4.488 | L'Oreal SA | 1.790.712 | 0,23 |
| | | 1.985.211 | 0,25 | 4.263 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 3.469.656 | 0,44 |
| | | | | 3.392 | Sartorius Stedim Biotech | 833.075 | 0,11 |
| | | | | 10.367 | Schneider Electric SE | 1.672.612 | 0,21 |
| | | | | 1.150 | Teleperformance | 160.885 | 0,02 |
| | | | | 11.880 | Worldline SA | 431.838 | 0,05 |
| | | | | | | 12.472.214 | 1,59 |
| | | | | Deutschland | | | |
| Österreich | | | | 8.308 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | 395.128 | 0,05 |
| 21.398 | ams-OSRAM AG | 146.711 | 0,02 | 9.176 | Infineon Technologies AG | 318.682 | 0,04 |
| 6.375 | ANDRITZ AG | 319.706 | 0,04 | 1.269 | Rational AG | 796.298 | 0,10 |
| 6.151 | Kontron AG | 117.730 | 0,01 | 5.755 | Siemens AG Reg | 882.472 | 0,11 |
| 8.512 | Verbund AG | 600.522 | 0,08 | 3.015 | SMA Solar Technology AG* | 303.008 | 0,04 |
| | | 1.184.669 | 0,15 | 3.335 | Software AG | 110.188 | 0,02 |
| | | | | 12.800 | Symrise AG | 1.279.744 | 0,16 |
| | | | | | | 4.085.520 | 0,52 |
| | | | | Irland | | | |
| Belgien | | | | 7.332 | Eaton Corp Plc | 1.209.735 | 0,16 |
| 2.572 | Aedifica SA (REIT) | 161.393 | 0,02 | 14.946.720 | Greencoat Renewables Plc | 15.880.890 | 2,03 |
| 31.759 | Umicore SA* | 825.734 | 0,11 | 18.097 | Kingspan Group Plc (traded in Ireland) | 1.123.462 | 0,14 |
| | | 987.127 | 0,13 | 2.974 | Kingspan Group Plc (traded in United Kingdom) | 187.362 | 0,02 |
| | | | | 2.586 | Linde Plc (traded in Germany) | 862.819 | 0,11 |
| Bermuda | | | | 24.946 | Origin Enterprises Plc | 87.311 | 0,01 |
| 6.748 | Bunge Ltd | 586.375 | 0,08 | 23.538 | Pentair Plc | 1.224.700 | 0,16 |
| 29.000 | Digital China Holdings Ltd | 11.085 | 0,00 | 5.944 | Seagate Technology Holdings Plc | 335.085 | 0,04 |
| | | 597.460 | 0,08 | 10.101 | Smurfit Kappa Group Plc | 335.656 | 0,04 |
| | | | | | | 21.247.020 | 2,71 |
| Brasilien | | | | Israel | | | |
| 19.640 | Klabin SA (Unit) | 75.460 | 0,01 | 37.064 | ICL Group Ltd | 189.144 | 0,02 |
| 21.338 | SLC Agricola SA | 134.933 | 0,02 | | | 189.144 | 0,02 |
| 34.544 | Suzano SA | 283.287 | 0,03 | Italien | | | |
| | | 493.680 | 0,06 | 22.048 | Enav SpA | 87.090 | 0,01 |
| | | | | 21.207 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | 252.363 | 0,03 |
| Britische Jungferninseln | | | | 148.776 | Snam SpA | 727.515 | 0,10 |
| 2.887 | Capri Holdings Ltd | 95.051 | 0,01 | 112.518 | Terna - Rete Elettrica Nazionale | 881.241 | 0,11 |
| | | 95.051 | 0,01 | | | 1.948.209 | 0,25 |
| | | | | Japan | | | |
| Kanada | | | | 14.800 | Daiichi Sankyo Co Ltd | 451.104 | 0,06 |
| 19.726 | Borealex Inc 'A' | 510.590 | 0,06 | 129.800 | ENEOS Holdings Inc | 404.170 | 0,05 |
| 5.962 | Cameco Corp | 155.473 | 0,02 | 500 | Fujitsu Ltd | 59.483 | 0,01 |
| 7.196 | Canadian Pacific Kansas City Ltd | 513.649 | 0,07 | 10.100 | Idemitsu Kosan Co Ltd* | 183.624 | 0,02 |
| 6.497 | Canadian Solar Inc | 254.736 | 0,03 | 5.500 | Kubota Corp | 71.155 | 0,01 |
| 4.151 | Canfor Corp | 54.969 | 0,01 | 4.600 | Kurita Water Industries Ltd* | 176.341 | 0,02 |
| 13.376 | Enbridge Inc | 441.113 | 0,06 | 24.500 | Oji Holdings Corp | 88.328 | 0,01 |
| 14.937 | Hydro One Ltd | 398.794 | 0,05 | 4.200 | Omron Corp | 237.563 | 0,03 |
| 4.966 | Magna International Inc | 225.075 | 0,03 | 34.000 | Renesas Electronics Corp | 522.725 | 0,07 |
| 7.716 | Nutrien Ltd | 380.808 | 0,05 | 6.400 | Sumitomo Forestry Co Ltd | 135.132 | 0,02 |
| 18.134 | Pembina Pipeline Corp | 514.306 | 0,07 | | | | |
| 61.706 | Western Forest Products Inc | 43.007 | 0,00 | | | | |
| | | 3.492.520 | 0,45 | | | | |
| | | | | Kaimaninseln | | | |
| 2.380 | Ambarella Inc | 161.450 | 0,02 | | | | |
| 21.304 | IHS Holding Ltd | 164.860 | 0,02 | | | | |
| | | 326.310 | 0,04 | | | | |
| | | | | Curaçao | | | |
| 30.274 | Schlumberger NV | 1.216.241 | 0,16 | | | | |
| | | 1.216.241 | 0,16 | | | | |
| | | | | Dänemark | | | |
| 30.103 | Novo Nordisk A/S 'B' | 4.512.060 | 0,58 | | | | |
| 1.834 | Novozymes A/S 'B' | 82.675 | 0,01 | | | | |
| 17.705 | Orsted A/S | 1.450.270 | 0,19 | | | | |
| 874 | ROCKWOOL A/S 'B' | 194.941 | 0,02 | | | | |
| 33.479 | Vestas Wind Systems A/S | 891.674 | 0,11 | | | | |
| | | 7.131.620 | 0,91 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------|---|------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Japan Fortsetzung | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| 4.500 | West Japan Railway Co | 176.465 | 0,02 | 1.544 | Flughafen Zurich AG Reg [^] | 278.200 | 0,03 |
| 5.100 | Yamaha Motor Co Ltd | 117.784 | 0,01 | 2.944 | Lonza Group AG Reg | 1.720.045 | 0,22 |
| 3.700 | Yaskawa Electric Corp | 146.559 | 0,02 | 17.962 | Nestle SA Reg | 1.988.660 | 0,25 |
| | | 2.770.433 | 0,35 | 49.495 | Siemens Energy AG | 1.175.011 | 0,15 |
| | | | | 18.444 | SIG Group AG [^] | 470.101 | 0,06 |
| Jersey | | | | 1.085 | TE Connectivity Ltd | 124.651 | 0,02 |
| 1.552 | Ferguson Plc [^] | 210.650 | 0,03 | 364 | VAT Group AG [^] | 140.173 | 0,02 |
| | | 210.650 | 0,03 | 1.089 | Zurich Insurance Group AG | 476.016 | 0,06 |
| | | | | | | 7.836.913 | 1,00 |
| Niederlande | | | | Taiwan | | | |
| 186 | Adyen NV [^] | 283.985 | 0,04 | 3.271 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 302.493 | 0,04 |
| 8.658 | ASML Holding NV [^] | 5.813.847 | 0,74 | | | 302.493 | 0,04 |
| 11.829 | CNH Industrial NV (traded in Italy) [^] | 141.357 | 0,02 | Vereinigte Arabische Emirate | | | |
| 53.860 | CNH Industrial NV (traded in United States) | 648.179 | 0,08 | 239.038 | Salik Co PJSC | 180.692 | 0,02 |
| 2.880 | Corbion NV | 73.958 | 0,01 | | | 180.692 | 0,02 |
| 9.338 | Ferrari NV | 2.489.511 | 0,32 | Großbritannien | | | |
| 1.240 | Koninklijke DSM NV | 141.422 | 0,02 | 195.425 | Auto Trader Group Plc | 1.431.311 | 0,18 |
| 3.865 | Koninklijke Philips NV | 68.202 | 0,01 | 459.135 | BP Plc | 2.419.578 | 0,31 |
| 17.270 | Koninklijke Vopak NV | 567.319 | 0,07 | 13.350.685 | Forward Partners Group Plc | 5.665.129 | 0,72 |
| 2.078 | NXP Semiconductors NV | 349.094 | 0,04 | 7.125 | Halma Plc | 199.542 | 0,03 |
| 9.384 | STMicroelectronics NV | 380.709 | 0,05 | 158.149 | Helios Towers Plc | 165.747 | 0,02 |
| | | 10.957.583 | 1,40 | 177.874 | ITM Power Plc | 143.180 | 0,02 |
| Norwegen | | | | 8.609 | Johnson Matthey Plc | 173.146 | 0,02 |
| 8.399 | Aker BP ASA | 170.532 | 0,02 | 28.536 | London Stock Exchange Group Plc | 2.836.434 | 0,36 |
| 325.452 | Aker Carbon Capture ASA | 340.807 | 0,04 | 23.878 | Michael Page International Plc | 120.754 | 0,02 |
| 15.038 | Equinor ASA | 359.193 | 0,05 | 67.068 | National Grid Plc | 862.351 | 0,11 |
| 23.433 | Leroy Seafood Group ASA | 97.918 | 0,01 | 100.399 | Pennon Group Plc | 902.824 | 0,11 |
| 24.944 | Mowi ASA | 400.003 | 0,05 | 36.566 | RELX Plc | 1.067.000 | 0,14 |
| 144.720 | NEL ASA [^] | 171.405 | 0,02 | 15.259 | Severn Trent Plc | 491.914 | 0,06 |
| 12.258 | Nordic Semiconductor ASA [^] | 120.005 | 0,02 | 90.109 | Smart Metering Systems Plc | 825.482 | 0,10 |
| 5.284 | Salmar ASA | 217.507 | 0,03 | 16.429 | Spirax-Sarco Engineering Plc | 2.086.633 | 0,27 |
| 7.352 | TOMRA Systems ASA | 109.233 | 0,01 | 40.361 | Spirent Communications Plc [^] | 84.225 | 0,01 |
| | | 1.986.603 | 0,25 | 77.389 | SSE Plc | 1.692.766 | 0,22 |
| Portugal | | | | 14.420 | United Utilities Group Plc [^] | 169.736 | 0,02 |
| 108.778 | EDP - Energias de Portugal SA | 496.245 | 0,06 | | | 21.337.752 | 2,72 |
| 23.283 | Galp Energia SGPS SA | 230.409 | 0,03 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 111.243 | REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA | 278.664 | 0,04 | 3.552 | A O Smith Corp | 213.033 | 0,03 |
| | | 1.005.318 | 0,13 | 16.582 | A10 Networks Inc | 231.597 | 0,03 |
| Südkorea | | | | 20.787 | AAR Corp | 977.053 | 0,12 |
| 827 | Samsung Electronics Co Ltd GDR | 1.046.452 | 0,13 | 1.523 | Adobe Inc | 596.843 | 0,08 |
| | | 1.046.452 | 0,13 | 10.308 | Advanced Micro Devices Inc | 1.142.959 | 0,15 |
| Spanien | | | | 9.966 | AeroVironment Inc [^] | 873.205 | 0,11 |
| 4.056 | Acciona SA | 613.673 | 0,08 | 6.952 | AGCO Corp | 719.132 | 0,09 |
| 1.156 | Aena SME SA | 169.007 | 0,02 | 2.920 | Agilent Technologies Inc | 316.815 | 0,04 |
| 18.667 | Cellnex Telecom SA [^] | 707.666 | 0,09 | 674 | Air Products and Chemicals Inc | 170.153 | 0,02 |
| 74.615 | EDP Renovaveis SA | 1.386.347 | 0,18 | 2.385 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | 253.824 | 0,03 |
| | | 2.876.693 | 0,37 | 10.396 | Alphabet Inc 'A' | 1.198.158 | 0,15 |
| Schweden | | | | 6.076 | Amazon.com Inc | 687.219 | 0,09 |
| 62.281 | Assa Abloy AB 'B' | 1.292.532 | 0,17 | 3.585 | American Tower Corp (REIT) | 620.221 | 0,08 |
| 5.202 | Getinge AB 'B' | 111.859 | 0,01 | 7.469 | American Water Works Co Inc | 1.012.003 | 0,13 |
| 144.293 | Hexagon AB 'B' | 1.564.427 | 0,20 | 6.047 | Analog Devices Inc | 1.007.871 | 0,13 |
| 8.912 | Holmen AB 'B' | 315.219 | 0,04 | 2.071 | ANSYS Inc | 628.604 | 0,08 |
| 3.573 | Lundin Energy AB [^] | 3.395 | 0,00 | 11.556 | Apple Inc | 1.921.302 | 0,24 |
| 24.969 | Nibe Industrier AB 'B' ^{**} | 222.833 | 0,03 | 4.613 | Applied Materials Inc | 576.787 | 0,07 |
| 33.227 | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | 412.080 | 0,05 | 8.827 | Archer-Daniels-Midland Co | 584.961 | 0,07 |
| 19.550 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 94.557 | 0,01 | 4.892 | Arista Networks Inc | 763.282 | 0,10 |
| | | 4.016.902 | 0,51 | 1.668 | Aspen Technology Inc [^] | 256.466 | 0,03 |
| Schweiz | | | | 1.685 | Badger Meter Inc | 217.907 | 0,03 |
| 11.701 | ABB Ltd Reg | 399.328 | 0,05 | 5.112 | Ball Corp | 245.315 | 0,03 |
| 2.504 | Belimo Holding AG Reg | 1.064.728 | 0,14 | 2.232 | Block Inc | 126.433 | 0,02 |
| | | | | 10.489 | Bloom Energy Corp 'A' | 134.986 | 0,02 |
| | | | | 7.786 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | 734.561 | 0,09 |
| | | | | 10.028 | Boston Scientific Corp | 484.233 | 0,06 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.867 | Broadcom Inc | 1.414.934 | 0,18 | 8.266 | Newmont Corp [^] | 314.404 | 0,04 |
| 9.427 | Cadence Design Systems Inc | 2.041.823 | 0,26 | 6.221 | NVIDIA Corp | 2.207.722 | 0,28 |
| 10.316 | California Water Service Group | 550.683 | 0,07 | 4.215 | Occidental Petroleum Corp | 227.968 | 0,03 |
| 15.498 | CECO Environmental Corp | 156.419 | 0,02 | 4.997 | ON Semiconductor Corp | 391.848 | 0,05 |
| 3.774 | CEVA Inc | 88.571 | 0,01 | 9.278 | Oracle Corp | 921.969 | 0,12 |
| 6.643 | Cheniere Energy Inc | 870.924 | 0,11 | 9.743 | Ormat Technologies Inc | 777.722 | 0,10 |
| 24.341 | Chico's FAS Inc | 103.656 | 0,01 | 2.139 | Ouster Inc | 13.663 | 0,00 |
| 19.594 | Cisco Systems Inc | 912.892 | 0,12 | 2.782 | Packaging Corp of America | 323.658 | 0,04 |
| 28.007 | Clearway Energy Inc 'C' | 754.752 | 0,10 | 3.836 | Palo Alto Networks Inc | 767.811 | 0,10 |
| 59.011 | CommScope Holding Co Inc | 230.265 | 0,03 | 3.628 | Paychex Inc | 357.083 | 0,05 |
| 90.749 | Conduent Inc | 257.921 | 0,03 | 19.978 | Physicians Realty Trust (REIT) | 255.979 | 0,03 |
| 1.033 | Consolidated Edison Inc | 90.403 | 0,01 | 3.759 | Pioneer Natural Resources Co | 703.212 | 0,09 |
| 18.618 | CSX Corp | 535.610 | 0,07 | 2.769 | PotlatchDeltic Corp (REIT) [^] | 120.853 | 0,02 |
| 6.258 | Curtiss-Wright Corp | 927.811 | 0,12 | 4.455 | PTC Inc | 561.628 | 0,07 |
| 2.125 | Danaher Corp | 457.689 | 0,06 | 2.417 | Qorvo Inc | 220.502 | 0,03 |
| 1.240 | Darling Ingredients Inc [^] | 73.718 | 0,01 | 3.071 | QUALCOMM Inc | 326.688 | 0,04 |
| 4.481 | Deere & Co | 1.454.212 | 0,19 | 17.894 | Rambus Inc | 1.073.539 | 0,14 |
| 777 | Dexcom Inc | 85.462 | 0,01 | 9.563 | Rayonier Inc (REIT) [^] | 263.003 | 0,03 |
| 3.761 | Digi International Inc | 126.825 | 0,02 | 8.473 | Republic Services Inc | 1.125.627 | 0,14 |
| 4.704 | Digital Realty Trust Inc (REIT) | 452.089 | 0,06 | 12.697 | Resideo Technologies Inc | 190.913 | 0,02 |
| 16.700 | DocGo Inc [^] | 140.198 | 0,02 | 507 | Rockwell Automation Inc | 132.492 | 0,02 |
| 19.397 | Donaldson Co Inc | 1.064.915 | 0,14 | 4.517 | S&P Global Inc [^] | 1.556.778 | 0,20 |
| 6.153 | Dover Corp | 769.514 | 0,10 | 36.098 | Sabre Corp | 104.966 | 0,01 |
| 7.105 | Dow Inc | 325.093 | 0,04 | 3.157 | Salesforce Inc | 661.486 | 0,08 |
| 3.122 | Dynatrace Inc | 149.321 | 0,02 | 4.166 | SBA Communications Corp (REIT) | 866.650 | 0,11 |
| 7.763 | Ecolab Inc | 1.201.841 | 0,15 | 2.696 | Silicon Laboratories Inc [^] | 355.732 | 0,05 |
| 1.669 | Emerson Electric Co | 121.610 | 0,02 | 2.478 | Skyworks Solutions Inc | 240.594 | 0,03 |
| 10.098 | EnerSys | 921.332 | 0,12 | 4.622 | Splunk Inc | 430.465 | 0,05 |
| 674 | Enphase Energy Inc | 109.929 | 0,01 | 16.050 | Steelcase Inc 'A' | 97.706 | 0,01 |
| 12.519 | EOG Resources Inc | 1.259.885 | 0,16 | 9.687 | SunPower Corp | 96.316 | 0,01 |
| 699 | Equinix Inc (REIT) | 488.828 | 0,06 | 8.964 | Sunrun Inc | 148.321 | 0,02 |
| 4.306 | Equity Residential (REIT) | 245.572 | 0,03 | 2.910 | Terex Corp [^] | 126.570 | 0,02 |
| 23.980 | Essential Utilities Inc | 916.373 | 0,12 | 1.242 | Tesla Inc | 237.577 | 0,03 |
| 11.084 | Eversource Energy | 719.768 | 0,09 | 2.051 | Texas Instruments Inc | 334.516 | 0,04 |
| 9.460 | Exelon Corp | 351.833 | 0,04 | 1.684 | Timken Co | 113.020 | 0,01 |
| 2.570 | F5 Inc | 355.764 | 0,05 | 17.698 | Trimble Inc | 774.754 | 0,10 |
| 1.266 | Fair Isaac Corp | 935.362 | 0,12 | 37.787 | Triumph Group Inc [^] | 396.620 | 0,05 |
| 5.643 | First Solar Inc | 1.074.292 | 0,14 | 25.256 | V2X Inc | 977.216 | 0,12 |
| 14.081 | Fluence Energy Inc | 327.557 | 0,04 | 2.960 | VeriSign Inc | 620.042 | 0,08 |
| 9.341 | Fortinet Inc | 598.697 | 0,08 | 3.203 | Visa Inc 'A' | 664.064 | 0,08 |
| 660 | FTI Consulting Inc | 116.393 | 0,01 | 8.251 | VMware Inc 'A' | 1.054.806 | 0,13 |
| 2.324 | Generac Holdings Inc | 237.436 | 0,03 | 40.686 | Vuzix Corp | 191.580 | 0,02 |
| 28.304 | Graphic Packaging Holding Co | 634.523 | 0,08 | 1.164 | Waste Management Inc [^] | 176.789 | 0,02 |
| 11.939 | Hain Celestial Group Inc [^] | 136.737 | 0,02 | 7.648 | Watts Water Technologies Inc 'A' | 1.136.690 | 0,14 |
| 41.253 | Halliburton Co | 1.108.618 | 0,14 | 11.944 | Westrock Co | 313.809 | 0,04 |
| 1.973 | Hershey Co | 480.619 | 0,06 | 13.284 | Weyerhaeuser Co (REIT) | 357.114 | 0,05 |
| 16.433 | Hexcel Corp | 1.063.420 | 0,14 | 19.895 | Williams Cos Inc | 534.838 | 0,07 |
| 26.658 | Howmet Aerospace Inc | 1.068.970 | 0,14 | 12.525 | Xylem Inc | 1.177.192 | 0,15 |
| 15.415 | Intel Corp | 454.599 | 0,06 | 1.221 | Zebra Technologies Corp 'A' | 300.720 | 0,04 |
| 6.067 | International Business Machines Corp | 731.784 | 0,09 | | | 87.608.223 | 11,17 |
| 1.426 | Intuit Inc | 560.609 | 0,07 | | | 201.008.157 | 25,63 |
| 4.032 | Johnson & Johnson | 586.438 | 0,07 | Gesamt Stammaktien | | | |
| 18.381 | Juniper Networks Inc | 523.620 | 0,07 | | | | |
| 22.103 | Kaman Corp | 430.823 | 0,05 | ANLEIHEN | | | |
| 5.886 | Kellogg Co | 368.641 | 0,05 | | Großbritannien | | |
| 3.792 | Kimberly-Clark Corp | 477.619 | 0,06 | GBP 14.521.457 | United Kingdom Gilt RegS 3,25% 31/1/2033 | 15.657.032 | 2,00 |
| 69.881 | Kinder Morgan Inc | 1.055.982 | 0,13 | | | 15.657.032 | 2,00 |
| 2.841 | Lindsay Corp | 313.920 | 0,04 | Gesamt Anleihen | | 15.657.032 | 2,00 |
| 4.657 | LKQ Corp | 230.426 | 0,03 | | | | |
| 7.371 | Marvell Technology Inc | 404.399 | 0,05 | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| 1.440 | Masimo Corp | 218.600 | 0,03 | | Guernsey | | |
| 2.613 | MasTec Inc [^] | 248.432 | 0,03 | GBP 17.063.049 | Bluefield Solar Income Fund Ltd | 25.748.074 | 3,28 |
| 8.379 | Mastercard Inc 'A' | 2.868.869 | 0,37 | USD 5.475.882 | Schiehallion Fund Ltd 'C' | 2.234.319 | 0,29 |
| 3.965 | Meta Platforms Inc 'A' | 984.537 | 0,13 | GBP 4.164.849 | Starwood European Real Estate Finance Ltd | 4.241.474 | 0,54 |
| 6.508 | MetLife Inc | 302.478 | 0,04 | | | 32.223.867 | 4,11 |
| 5.414 | Microchip Technology Inc | 382.194 | 0,05 | | | | |
| 5.941 | Micron Technology Inc | 380.054 | 0,05 | | | | |
| 15.681 | Microsoft Corp | 4.830.205 | 0,62 | | | | |
| 12.217 | Mosaic Co | 366.246 | 0,05 | | | | |
| 5.729 | NetApp Inc | 356.551 | 0,05 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Irland | | | | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 180.533 | iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF [^] | 16.255.191 | 2,07 | Luxemburg | | | |
| EUR 1.990.000 | iShares EUR Ultrashort Bond ESG UCITS ETF [^] D ⁻ | 10.022.038 | 1,28 | 2.016.356 | BlackRock Global Funds - Emerging Markets Equity Income Fund X2 (USD) ⁻ | 31.509.689 | 4,02 |
| USD 974.178 | iShares Physical Gold ETC ⁻ | 35.089.037 | 4,47 | 3.653.658 | BlackRock Global Funds - Euro Corporate Bond Fund X2 (EUR) ⁻ | 64.706.283 | 8,25 |
| USD 169.964 | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF (Dist) ⁻ | 14.104.409 | 1,80 | 1.494.747 | BlackRock Global Funds - Euro Short Duration Bond Fund X2 (EUR) ⁻ | 25.051.960 | 3,19 |
| | | 75.470.675 | 9,62 | 8.580.194 | BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund X2 (EUR) Hedged ⁻ | 115.746.811 | 14,76 |
| Jersey | | | | 1.607.019 | BlackRock Global Funds - Global High Yield Bond Fund I2 (EUR) Hedged (Acc) ⁻ | 16.295.173 | 2,08 |
| EUR 16.261.248 | Blackstone Loan Financing Ltd | 11.138.955 | 1,42 | | | 253.309.916 | 32,30 |
| GBP 13.196.881 | Foresight Solar Fund Ltd | 16.231.938 | 2,07 | Irland | | | |
| | | 27.370.893 | 3,49 | 41.966 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 4.177.114 | 0,53 |
| Großbritannien | | | | 214.733 | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) ⁻ | 24.951.293 | 3,18 |
| GBP 1.055.354 | BlackRock Frontiers Investment Trust Plc ⁻ | 1.659.392 | 0,21 | 981.518 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) ⁻ | 92.090.023 | 11,75 |
| GBP 2.252.650 | Scottish Mortgage Investment Trust Plc | 17.436.163 | 2,23 | 912.773 | iShares Developed World Index Fund (Acc) ⁻ | 35.595.409 | 4,54 |
| | | 19.095.555 | 2,44 | | | 156.813.839 | 20,00 |
| Gesamt börsengehandelte Fonds | | 154.160.990 | 19,66 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 410.123.755 | 52,30 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 370.826.179 | 47,29 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 780.957.831 | 99,59 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 3.246.339 | 0,41 |
| STAMMAKTIE & WARRANTS | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 784.204.170 | 100,00 |
| Frankreich | | | | | | | |
| 10.931 | Fermentalg (Wts 15/12/2023) | — | 0,00 | | | | |
| | | — | 0,00 | | | | |
| Spanien | | | | | | | |
| 425 | Edp Renovaveis Sa | 7.897 | 0,00 | | | | |
| | | 7.897 | 0,00 | | | | |
| Gesamt Stammaktien & Warrants | | 7.897 | 0,00 | | | | |
| Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 7.897 | 0,00 | | | | |

[^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.
⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|----------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| ILS | EUR 1.632.000 | Fund receives Fixed 2,495% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Goldman Sachs | 15/4/2052 | (215.737) | (215.737) |
| ILS | EUR 1.182.028 | Fund receives Fixed 2,508% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Goldman Sachs | 15/4/2052 | (151.953) | (151.953) |
| ILS | EUR 1.652.000 | Fund receives Fixed 2,535% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Goldman Sachs | 15/4/2052 | (199.071) | (199.071) |
| ILS | EUR 1.520.000 | Fund receives Fixed 2,580% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Goldman Sachs | 15/3/2052 | (181.441) | (181.441) |
| ILS | EUR 5.202.460 | Fund receives Fixed 2,758% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Morgan Stanley | 15/5/2053 | 55.581 | 55.581 |
| ILS | EUR 2.632.560 | Fund receives Fixed 2,560% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | UBS | 15/4/2052 | (297.821) | (297.821) |
| ILS | EUR 3.300.000 | Fund receives Fixed 2,585% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | UBS | 15/4/2052 | (348.826) | (348.826) |
| TRS | USD 7.925.569 | Fund receives Volatility Carry Strategy Index and pays Fixed 0,530% | Barclays Bank | 17/11/2023 | 52.814 | 52.814 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|----------------|--|----------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| TRS | USD 17.746.042 | Fund receives Global Brands Basket Index and pays 12 Month SOFR | Citibank | 1/9/2023 | 3.817.216 | 3.817.216 |
| TRS | USD 13.545.925 | Fund receives 3 Month FEDL and pays GS US NonProfit Tech GTR Index | Goldman Sachs | 13/2/2024 | (924.674) | (924.674) |
| TRS | USD 4.344.944 | Fund receives 3 Month SOFR and pays Transition Leader Short Basket Index | HSBC | 13/12/2023 | 70.212 | 70.212 |
| TRS | USD 4.344.944 | Fund receives 3 Month SOFR and pays Transition Leader Short Basket Index | HSBC | 13/12/2023 | 70.212 | 70.212 |
| TRS | USD 2.172.472 | Fund receives 3 Month SOFR and pays Transition Leader Short Basket Index | HSBC | 13/12/2023 | 35.106 | 35.106 |
| TRS | USD 3.247.785 | Fund receives 3 Month SOFR and pays Transition Leader Short Basket Index | HSBC | 13/12/2023 | 52.482 | 52.482 |
| TRS | USD 4.176.556 | Fund receives Transition Leaders Long Basket Index and pays 3 Month SOFR | HSBC | 13/12/2023 | (90.526) | (90.526) |
| TRS | USD 4.176.556 | Fund receives Transition Leaders Long Basket Index and pays 3 Month SOFR | HSBC | 13/12/2023 | (90.526) | (90.526) |
| TRS | USD 2.088.336 | Fund receives Transition Leaders Long Basket Index and pays 3 Month SOFR | HSBC | 13/12/2023 | (45.264) | (45.264) |
| TRS | USD 4.176.672 | Fund receives Transition Leaders Long Basket Index and pays 3 Month SOFR | HSBC | 13/12/2023 | (90.528) | (90.528) |
| TRS | USD 3.150.597 | Fund receives Transition Leaders Long Basket Index and pays 3 Month SOFR | HSBC | 13/12/2023 | (68.288) | (68.288) |
| TRS | USD 28.498.084 | Fund receives USD Rates Volatility Strategy Index and pays Fixed 0,000% | JP Morgan | 21/2/2024 | (28.609) | (28.609) |
| TRS | EUR 4.300.714 | Fund receives Morgan Stanley European Volatility Carry Index and pays Fixed 0,000% | Morgan Stanley | 24/7/2023 | 163.496 | 163.496 |
| TRS | USD 19.491.790 | Fund receives Aquantum Scarcity Premium Commodity Index and pays Fixed 0,000% | UBS | 9/8/2023 | 570.209 | 570.209 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 136.816.252) | | | | | 2.154.064 | 2.154.064 |

ILS: Inflationsgebundene Swaps
TRS: Gesamtertrag-Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 107 | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 7.788.536 | 3.133 |
| 230 | USD | Cboe Volatility Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 4.069.948 | (1.474.277) |
| (735) | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 30.994.950 | (1.269.551) |
| (142) | GBP | FTSE 100 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 12.301.968 | 177.337 |
| Gesamt | | | | | (2.563.358) |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|--|---------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 17.012.942 | Put | S&P 500 Index & OTC USD/JPY (Dual Digital) | BNP Paribas | USD 125,00 | 15/12/2023 | (1.542) | 177.135 |
| 37.300.000 | Call | OTC USD/JPY | Goldman Sachs | USD 136,00 | 01/03/2033 | 178.889 | 507.981 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 3.408.638) | | | | | | 177.347 | 685.116 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|---------------|---------|----------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| BRL | 43.350.000 | USD | 8.429.752 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | (29.657) |
| EUR | 114.545.126 | GBP | 100.776.000 | BNP Paribas | 18/7/2023 | (2.411.487) |
| EUR | 2.654.127 | HUF | 1.015.100.000 | Deutsche Bank | 18/7/2023 | (42.209) |
| EUR | 288.285.658 | USD | 316.000.000 | BNP Paribas | 18/7/2023 | (7.321.068) |
| HUF | 1.015.100.000 | EUR | 2.607.501 | HSBC | 18/7/2023 | 88.836 |
| MXN | 86.800.000 | USD | 4.691.511 | Barclays Bank | 18/7/2023 | 140.425 |
| USD | 25.529.487 | CNH | 179.000.000 | HSBC | 18/7/2023 | 288.602 |
| USD | 19.698.814 | KRW | 25.900.000.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | 106.931 |
| USD | 4.752.258 | MXN | 86.800.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | (83.598) |
| USD | 54.035.949 | TWD | 1.629.400.000 | Goldman Sachs | 18/7/2023 | 834.975 |
| USD | 5.280.494 | ZAR | 102.600.000 | Goldman Sachs | 18/7/2023 | 118.200 |
| ZAR | 102.600.000 | USD | 5.542.800 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | (363.579) |
| | | | | | | (8.673.629) |
| Auf CAD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CAD | 8.687 | EUR | 5.889 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 102 |
| EUR | 59 | CAD | 86 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| | | | | | | 102 |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 115 | JPY | 17.022 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1 |
| JPY | 599.041 | EUR | 4.028 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1) |
| | | | | | | — |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 356.057 | SEK | 4.037.305 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 8.123 |
| SEK | 146.944.919 | EUR | 13.109.031 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (445.339) |
| | | | | | | (437.216) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 1.093.071 | USD | 1.195.739 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (27.687) |
| USD | 69.820.420 | EUR | 63.083.376 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 2.358.824 |
| | | | | | | 2.331.137 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 735.428.890) | | | | | | (6.779.606) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 52,30 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 19,66 |
| Industrie | 5,49 |
| Technologie | 5,03 |
| Finanzen | 4,23 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 3,00 |
| Energie | 2,20 |
| Versorger | 2,05 |
| Staatsanleihen | 2,00 |
| Zyklische Konsumgüter | 1,42 |
| Kommunikation | 1,18 |
| Grundstoffe | 1,03 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,59 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,41 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---------------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIE | | | | | | | |
| Großbritannien | | | | | | | |
| 1.323.608 | Breedon Group Plc | 4.599.538 | 1,34 | | | | |
| 131.463 | CVS Group Plc | 2.755.464 | 0,80 | | | | |
| 349.734 | Ergomed Plc | 3.602.260 | 1,05 | | | | |
| 582.645 | Gamma Communications Plc | 6.758.682 | 1,96 | | | | |
| 225.636 | Impax Asset Management Group Plc | 1.574.939 | 0,46 | | | | |
| 5.098.543 | SigmaRoc Plc | 2.977.549 | 0,86 | | | | |
| 418.326 | YouGov Plc | 4.078.679 | 1,19 | | | | |
| | | 26.347.111 | 7,66 | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| 2.214.959 | Boku Inc Reg | 3.145.242 | 0,91 | | | | |
| 13.929 | Meta Platforms Inc 'A' | 2.950.532 | 0,86 | | | | |
| | | 6.095.774 | 1,77 | | | | |
| Gesamt Stammaktien | | | | | | 32.442.885 | 9,43 |
| EINLAGENZERTIFIKATE | | | | | | | |
| Australien | | | | | | | |
| GBP 3.000.000 | National Australia Bank Ltd FRN 5/1/2024 | 3.000.000 | 0,87 | | | | |
| GBP 4.000.000 | National Australia Bank Ltd FRN 8/1/2024 | 4.000.000 | 1,17 | | | | |
| | | 7.000.000 | 2,04 | | | | |
| Frankreich | | | | | | | |
| GBP 3.000.000 | Credit Agricole SA 3/10/2023 (Zero Coupon) | 2.953.325 | 0,86 | | | | |
| | | 2.953.325 | 0,86 | | | | |
| Japan | | | | | | | |
| GBP 12.000.000 | Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp FRN 24/8/2023 | 12.000.000 | 3,49 | | | | |
| GBP 1.000.000 | Mizuho Bank Ltd 4,50% 5/6/2023 | 999.981 | 0,29 | | | | |
| GBP 19.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp FRN 12/6/2023 | 19.000.000 | 5,52 | | | | |
| | | 31.999.981 | 9,30 | | | | |
| Niederlande | | | | | | | |
| GBP 10.000.000 | ABN AMRO Bank NV 1/6/2023 (Zero Coupon) | 9.997.483 | 2,91 | | | | |
| GBP 11.000.000 | ING Bank NV 6/11/2023 (Zero Coupon) | 10.752.098 | 3,12 | | | | |
| | | 20.749.581 | 6,03 | | | | |
| Großbritannien | | | | | | | |
| GBP 4.000.000 | DBS Bank LTD 30/8/2023 (Zero Coupon) | 3.951.440 | 1,15 | | | | |
| GBP 12.000.000 | Mizuho Bank Ltd 4,52% 12/6/2023 | 11.999.615 | 3,49 | | | | |
| | | 15.951.055 | 4,64 | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| GBP 10.000.000 | Bank of America NA 7/8/2023 (Zero Coupon) | 9.909.918 | 2,88 | | | | |
| | | 9.909.918 | 2,88 | | | | |
| Gesamt Einlagenzertifikate | | | | | | 88.563.860 | 25,75 |
| KURZFRISTIGE TITEL | | | | | | | |
| Australien | | | | | | | |
| GBP 6.000.000 | Toyota Finance Australia Ltd 12/9/2023 (Zero Coupon) | 5.919.530 | 1,72 | | | | |
| | | 5.919.530 | 1,72 | | | | |
| | | | | Belgien | | | |
| GBP 24.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 12/6/2023 (Zero Coupon) | 23.967.436 | 6,97 | | | | |
| | | 23.967.436 | 6,97 | | | | |
| | | | | Frankreich | | | |
| GBP 5.000.000 | Antalis SA 9/6/2023 (Zero Coupon) | 4.995.087 | 1,45 | | | | |
| GBP 1.000.000 | BRED Banque Populaire 24/8/2023 (Zero Coupon) | 988.973 | 0,29 | | | | |
| GBP 4.000.000 | Managed and Enhanced Tap Magenta Funding ST SA 1/6/2023 (Zero Coupon) | 4.000.000 | 1,16 | | | | |
| GBP 4.000.000 | Managed and Enhanced Tap Magenta Funding ST SA 1/6/2023 (Zero Coupon) | 3.989.625 | 1,16 | | | | |
| GBP 10.000.000 | Managed and Enhanced Tap Magenta Funding ST SA 9/6/2023 (Zero Coupon) | 9.990.175 | 2,91 | | | | |
| GBP 8.000.000 | Satellite SASU 22/6/2023 (Zero Coupon) | 7.979.354 | 2,32 | | | | |
| | | 31.943.214 | 9,29 | | | | |
| | | | | Deutschland | | | |
| GBP 12.000.000 | Allianz SE 26/7/2023 (Zero Coupon) | 11.918.118 | 3,46 | | | | |
| | | 11.918.118 | 3,46 | | | | |
| | | | | Irland | | | |
| GBP 8.000.000 | Matchpoint Finance Plc 12/6/2023 (Zero Coupon) | 7.989.193 | 2,32 | | | | |
| GBP 7.000.000 | Matchpoint Finance Plc 11/8/2023 (Zero Coupon) | 6.935.423 | 2,02 | | | | |
| | | 14.924.616 | 4,34 | | | | |
| | | | | Luxemburg | | | |
| GBP 2.000.000 | Albion Capital Corp SA 20/6/2023 (Zero Coupon) | 1.995.311 | 0,58 | | | | |
| GBP 15.000.000 | Sunderland Receivables SA 12/6/2023 (Zero Coupon) | 14.979.648 | 4,36 | | | | |
| | | 16.974.959 | 4,94 | | | | |
| | | | | Niederlande | | | |
| GBP 14.000.000 | PACCAR Financial Europe BV 14/6/2023 (Zero Coupon) | 13.977.636 | 4,06 | | | | |
| GBP 3.000.000 | Toyota Motor Finance 21/7/2023 (Zero Coupon) | 2.980.921 | 0,87 | | | | |
| | | 16.958.557 | 4,93 | | | | |
| | | | | Schweiz | | | |
| GBP 1.000.000 | UBS AG 5/6/2023 (Zero Coupon) | 999.539 | 0,29 | | | | |
| GBP 8.000.000 | UBS AG 6/6/2023 (Zero Coupon) | 7.995.387 | 2,33 | | | | |
| GBP 6.000.000 | UBS AG 7/6/2023 (Zero Coupon) | 5.995.857 | 1,74 | | | | |
| | | 14.990.783 | 4,36 | | | | |
| | | | | Großbritannien | | | |
| GBP 8.000.000 | National Westminster Bank Plc 1/6/2023 (Zero Coupon) | 8.000.000 | 2,33 | | | | |
| GBP 8.000.000 | National Westminster Bank Plc 1/6/2023 (Zero Coupon) | 7.993.209 | 2,32 | | | | |
| GBP 9.000.000 | National Westminster Bank Plc RegS 7/6/2023 (Zero Coupon) | 8.993.452 | 2,61 | | | | |
| | | 24.986.661 | 7,26 | | | | |
| | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| GBP 4.000.000 | Mont Blanc Capital Corp 15/6/2023 (Zero Coupon) | 3.993.094 | 1,16 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| GBP 11.000.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 12/6/2023 (Zero Coupon) | 10.985.141 | 3,20 |
| GBP 9.000.000 | Sheffield Receivables Co LLC 12/6/2023 (Zero Coupon) | 8.987.789 | 2,61 |
| | | 23.966.024 | 6,97 |
| | Gesamt kurzfristige Titel | 186.549.898 | 54,24 |
| | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | 307.556.643 | 89,42 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 330.848 | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) ⁻ | 33.067.374 | 9,61 |
| | | 33.067.374 | 9,61 |
| | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | 33.067.374 | 9,61 |
| | Wertpapiervermögen zum Marktwert | 340.624.017 | 99,03 |
| | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 3.332.474 | 0,97 |
| | Gesamt Netto-Fondsvermögen (GBP) | 343.956.491 | 100,00 |
| ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|-------------------------------------|-------------------------|---------------|---|-----------------------------------|---|------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | | | | |
| Australien | | | | | | | |
| 30.340 | Xero Ltd | HSBC | 267.253 | 111.691 | Bellway Plc | Goldman Sachs | (230.852) |
| | | | 267.253 | (1.500.000) | BioPharma Credit Plc | Goldman Sachs | 8.796 |
| | | | | (836.245) | Bridgepoint Group Plc Reg | HSBC | 113.060 |
| | | | | (69.419) | British American Tobacco Plc | HSBC | 149.955 |
| | | | | (926.110) | BT Group Plc | HSBC | (107.523) |
| | | | | 77.218 | Bunzl Plc | JP Morgan | 19.305 |
| (33.693) | Umicore SA | HSBC | 110.726 | (101.473) | Burberry Group Plc | HSBC | 336.768 |
| | | | 110.726 | 522.199 | Bytes Technology Group Plc | HSBC | 435.514 |
| | | | | 767.018 | Chemring Group Plc | JP Morgan | (153.404) |
| | | | | 385.189 | Compass Group Plc | JP Morgan | 577.783 |
| | | | | 141.661 | Computacenter Plc | JP Morgan | (25.499) |
| | | | | (311.794) | ConvaTec Group Plc | HSBC | 20.578 |
| | | | | (73.185) | Craneware Plc | Goldman Sachs | 201.259 |
| | | | | (21.784) | Croda International Plc | Goldman Sachs | 21.814 |
| 89.479 | Vestas Wind Systems A/S | HSBC | 58.861 | (49.981) | DCC Plc | Goldman Sachs | 22.491 |
| | | | 58.861 | 75.625 | Dechra Pharmaceuticals Plc | JP Morgan | (220.825) |
| | | | | 1.547.974 | Deliveroo Plc | HSBC | 3.096 |
| | | | | (72.584) | Diageo Plc | HSBC | 127.958 |
| (40.286) | Kone Oyj 'B' | Goldman Sachs | 12.192 | 108.127 | Diploma Plc | JP Morgan | 426.020 |
| 54.670 | Konecranes Oyj | HSBC | (46.835) | 735.825 | Dr Martens Plc | Goldman Sachs | (97.865) |
| | | | (34.643) | 178.929 | Dunelm Group Plc | HSBC | (108.624) |
| | | | | 220.298 | Electrocomponents Plc | Goldman Sachs | (122.045) |
| | | | | (89.495) | Energiean Plc | Goldman Sachs | (9.694) |
| | | | | (55.291) | Experian Plc | HSBC | (75.218) |
| | | | | (97.621) | Frasers Group Plc | Goldman Sachs | 99.085 |
| | | | | 417.927 | Future Plc | Goldman Sachs | (967.013) |
| | | | | 26.387 | Games Workshop Group Plc | HSBC | (75.203) |
| | | | | (50.376) | Genus Plc | HSBC | 25.188 |
| | | | | 824.633 | Grafton Group Plc (Unit) | HSBC | (128.643) |
| | | | | 416.522 | Great Portland Estates Plc (REIT) | HSBC | (91.218) |
| | | | | 126.191 | Halma Plc | HSBC | 29.024 |
| | | | | 172.524 | Hargreaves Lansdown Plc | Societe Generale | 20.405 |
| | | | | (480.644) | HgCapital Trust Plc | HSBC | (213.286) |
| | | | | (1.160.405) | Hicl Infrastructure Plc | HSBC | 109.078 |
| | | | | 137.975 | Hill & Smith Plc | HSBC | 168.330 |
| | | | | (1.551.252) | Hipgnosis Songs Fund Ltd | JP Morgan | 100.056 |
| | | | | 223.620 | Hiscox Ltd | Societe Generale | 49.196 |
| | | | | 611.410 | Howden Joinery Group Plc | HSBC | (240.896) |
| | | | | (979.389) | Ibstock Plc | Societe Generale | 149.651 |
| | | | | 130.961 | Indivior Plc | Goldman Sachs | (17.025) |
| | | | | 1.019.395 | IntegraFin Holdings Plc | JP Morgan | (366.982) |
| | | | | 226.439 | Intermediate Capital Group Plc | Goldman Sachs | 258.140 |
| | | | | (306.297) | International Distributions Services Plc | HSBC | 147.329 |
| | | | | (66.470) | Intertek Group Plc | Societe Generale | 16.618 |
| | | | | (552.357) | IWG Plc | Goldman Sachs | 20.414 |
| | | | | (1.011.830) | J Sainsbury Plc | JP Morgan | 186.177 |
| | | | | 1.179.725 | JD Sports Fashion Plc | Societe Generale | (105.409) |
| | | | | 207.037 | JET2 Plc | HSBC | 24.844 |
| | | | | (88.601) | Johnson Matthey Plc | HSBC | 162.054 |
| | | | | (538.454) | Kingfisher Plc | JP Morgan | 100.253 |
| | | | | (879.762) | Legal & General Group Plc | JP Morgan | (31.671) |
| | | | | (4.398.318) | Lloyds Banking Group Plc | HSBC | 70.153 |
| | | | | 89.343 | London Stock Exchange Group Plc | HSBC | 247.451 |
| | | | | 609.648 | Melrose Industries Plc | Goldman Sachs | 51.213 |
| | | | | 1.079.803 | Moneysupermarket.com Group Plc | HSBC | (192.809) |
| | | | | (795.307) | Moonpig Group Plc | JP Morgan | (6.362) |
| | | | | 166.684 | Morgan Sindall Group Plc | HSBC | 62.346 |
| | | | | (290.629) | National Express Group Plc | JP Morgan | 34.294 |
| | | | | (172.494) | National Grid Plc | Societe Generale | 79.347 |
| | | | | 190.298 | Next 15 Group Plc | HSBC | (148.432) |
| | | | | (827.211) | Ninety One Plc | Societe Generale | 176.196 |
| | | | | (1.265.980) | Octopus Renewables Infrastructure Trust Plc | HSBC | 58.235 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|---------------------------------------|--|------------------|---|---|---|---------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 537.486 | OSB Group Plc | JP Morgan | 8.600 | 17.182 | Danaher Corp | Goldman Sachs | (30.675) |
| 90.346 | Oxford Instruments Plc | JP Morgan | (65.009) | 18.011 | Dick's Sporting Goods Inc | Goldman Sachs | (138.222) |
| 119.893 | Persimmon Plc | Societe Generale | (158.858) | (22.697) | Edwards Lifesciences Corp | Goldman Sachs | 135.496 |
| (483.980) | Pets at Home Group Plc | HSBC | 60.014 | (10.938) | Equifax Inc | Goldman Sachs | (28.893) |
| 264.107 | Polar Capital Holdings Plc | HSBC | 92.437 | 26.780 | Herc Holdings Inc | Goldman Sachs | 20.768 |
| (1.963.129) | Primary Health Properties Plc (REIT) | HSBC | 80.347 | (5.416) | Home Depot Inc | JP Morgan | 10.107 |
| (754.040) | PZ Cussons Plc | JP Morgan | 102.549 | (28.858) | HP Inc | Goldman Sachs | (4.196) |
| 918.875 | QinetiQ Group Plc | JP Morgan | (115.512) | (12.259) | HP Inc | JP Morgan | 4.357 |
| 44.964 | Reckitt Benckiser Group Plc | Societe Generale | (80.036) | 4.650 | Intuit Inc | JP Morgan | (63.708) |
| (401.593) | Redde Northgate Plc | HSBC | 12.048 | (37.769) | Kraft Heinz Co | HSBC | 99.464 |
| 396.026 | RELX Plc | Goldman Sachs | 249.496 | 131.136 | Leslie's Inc | Goldman Sachs | (138.565) |
| (272.049) | Rentokil Initial Plc | Goldman Sachs | 11.812 | (4.917) | Lululemon Athletica Inc | JP Morgan | 200.350 |
| 1.004.920 | Rotork Plc | Societe Generale | (98.482) | (86.387) | Macerich Co (REIT) | JP Morgan | 28.612 |
| (174.247) | Sage Group Plc | HSBC | (118.488) | 16.722 | Mastercard Inc 'A' | Goldman Sachs | (316.636) |
| (652.231) | Scottish Mortgage Investment Trust Plc | JP Morgan | (366.554) | 28.800 | Microsoft Corp | Goldman Sachs | 589.541 |
| 454.073 | Serica Energy Plc | HSBC | (67.203) | 6.361 | MongoDB Inc | Goldman Sachs | 108.012 |
| (84.749) | Severn Trent Plc | Goldman Sachs | 100.851 | 38.159 | Nasdaq Inc | JP Morgan | (12.638) |
| 116.084 | Shell Plc | Societe Generale | (161.937) | 10.902 | NVIDIA Corp | Goldman Sachs | 811.601 |
| 5.681.686 | SIG Plc | HSBC | (124.997) | 33.694 | PayPal Holdings Inc | JP Morgan | (250.431) |
| (159.404) | Softcat Plc | HSBC | (57.385) | 55.687 | RingCentral Inc 'A' | Goldman Sachs | 291.503 |
| (15.440) | Spirax-Sarco Engineering Plc | Goldman Sachs | (24.767) | (171.807) | Robinhood Markets Inc 'A' | JP Morgan | (9.715) |
| 395.030 | Spirent Communications Plc | Goldman Sachs | 8.691 | (47.440) | Rollins Inc | Goldman Sachs | 127.807 |
| (545.978) | SSP Group Plc | Goldman Sachs | (57.874) | 1.721 | S&P Global Inc | Goldman Sachs | 528 |
| 395.037 | Standard Chartered Plc | Goldman Sachs | 71.897 | 17.977 | S&P Global Inc | HSBC | 97.008 |
| (17.780) | State Bank of India Reg GDR | JP Morgan | (2.873) | 227.377 | SiriusPoint Ltd | Goldman Sachs | 66.125 |
| (1.242.494) | Supermarket Income Plc (REIT) | JP Morgan | 68.311 | 44.312 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | Goldman Sachs | 415.235 |
| (121.385) | Telecom Plus Plc | Goldman Sachs | 300.230 | (11.756) | Target Corp | Goldman Sachs | 246.816 |
| (1.027.580) | Tesco Plc | Goldman Sachs | 117.144 | (19.203) | Texas Roadhouse Inc | Goldman Sachs | 7.446 |
| (94.359) | Travis Perkins Plc | Goldman Sachs | 44.537 | 659 | Thermo Fisher Scientific Inc | Goldman Sachs | (10.871) |
| (67.299) | Unilever Plc | Goldman Sachs | 189.783 | 11.706 | Thermo Fisher Scientific Inc | HSBC | (371.823) |
| (181.164) | United Utilities Group Plc | HSBC | 107.793 | 28.804 | Trade Desk Inc 'A' | Goldman Sachs | 134.492 |
| 300.092 | Vesuvius Plc | JP Morgan | 20.406 | 6.372 | United Rentals Inc | Goldman Sachs | 7.618 |
| 249.087 | Vesuvius Plc | Societe Generale | 16.938 | 18.360 | Visa Inc 'A' | Goldman Sachs | (229.741) |
| (1.520.782) | Vodafone Group Plc | Goldman Sachs | 190.402 | (58.120) | Warner Music Group Corp 'A' | JP Morgan | 211.747 |
| 1.058.071 | Watches of Switzerland Group Plc | HSBC | (893.115) | 47.964 | Wayfair Inc 'A' | Goldman Sachs | 141.496 |
| 432.232 | WH Smith Plc | Goldman Sachs | (354.430) | (42.999) | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Goldman Sachs | (12.157) |
| 129.688 | Whitbread Plc | Goldman Sachs | 49.281 | (7.419) | Wingstop Inc | Goldman Sachs | 52.920 |
| | | | 1.328.492 | | | | 2.968.705 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – GBP 412.326.822) | | | |
| 31.294 | Activision Blizzard Inc | Goldman Sachs | 52.329 | | | | 3.578.497 |
| 4.598 | Adobe Inc | JP Morgan | 92.607 | | | | |
| 26.480 | Agilent Technologies Inc | JP Morgan | (364.504) | | | | |
| 51.464 | Alphabet Inc 'A' | JP Morgan | 638.571 | | | | |
| 54.014 | Amazon.com Inc | Goldman Sachs | 411.248 | | | | |
| 19.257 | Applied Industrial Technologies Inc | HSBC | (52.269) | | | | |
| (77.345) | Arbor Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3.749 | | | | |
| (4.313) | Asbury Automotive Group Inc | Goldman Sachs | (37.872) | | | | |
| (11.433) | Atlassian Corp Ltd 'A' | JP Morgan | (394.554) | | | | |
| (15.207) | Block Inc | Goldman Sachs | (52.455) | | | | |
| (4.803) | Boston Beer Co Inc 'A' | JP Morgan | (95.369) | | | | |
| (50.489) | Campbell Soup Co | JP Morgan | 166.203 | | | | |
| (26.868) | CarMax Inc | Goldman Sachs | (11.069) | | | | |
| (7.701) | Casey's General Stores Inc | Goldman Sachs | 24.138 | | | | |
| (7.892) | Caterpillar Inc | Goldman Sachs | 26.394 | | | | |
| (60.100) | Cheesecake Factory Inc | Goldman Sachs | 1.457 | | | | |
| (40.962) | Chewy Inc 'A' | Goldman Sachs | 149.566 | | | | |
| (137.634) | CNH Industrial NV | Goldman Sachs | 126.749 | | | | |
| (84.017) | Conagra Brands Inc | Goldman Sachs | 137.099 | | | | |
| (3.496) | Costco Wholesale Corp | JP Morgan | (19.543) | | | | |
| 59.584 | Criteo SA ADR | Goldman Sachs | (24.548) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement GBP | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|-------------------------------------|-----------------|--|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (27) | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 4.573.796 | (264.626) |
| (614) | GBP | FTSE 100 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 45.970.180 | 663.597 |
| (524) | GBP | FTSE 250 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 19.753.752 | (96.738) |
| Gesamt | | | | | 302.233 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|--|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| AUD | 21.442.679 | GBP | 11.505.345 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (280.210) |
| GBP | 270.160 | AUD | 508.356 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 4.037 |
| | | | | | | (276.173) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 8.497.438 | GBP | 7.574.497 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (44.061) |
| GBP | 89.077 | CHF | 99.547 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 860 |
| | | | | | | (43.201) |
| Auf CNH lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CNH | 33.024 | GBP | 3.775 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (29) |
| GBP | 132 | CNH | 1.149 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1 |
| | | | | | | (28) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 177.875.775 | GBP | 155.318.355 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.818.674) |
| GBP | 3.129.667 | EUR | 3.594.201 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 28.014 |
| | | | | | | (1.790.660) |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 57.634 | JPY | 9.756.260 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1.310 |
| JPY | 27.684.977 | GBP | 162.555 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (2.726) |
| | | | | | | (1.416) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 2.909.270 | USD | 3.640.587 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (30.854) |
| USD | 78.693.300 | GBP | 62.139.574 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1.412.838 |
| | | | | | | 1.381.984 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - GBP 242.423.810) | | | | | | (729.494) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 73,80 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 9,61 |
| Industrie | 6,26 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 3,04 |
| Kommunikation | 2,82 |
| Zyklische Konsumgüter | 2,59 |
| Technologie | 0,91 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,03 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,97 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| | | Marktwert in USD | In % des NAV | | | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|--------------------|--|------------------------|--------------------|
| Bestand | Wertpapierbezeichnung | | | Bestand | Wertpapierbezeichnung | | |
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Hongkong | | | |
| | | | | 9.160.000 | Guangdong Investment Ltd | 7.799.029 | 1,74 |
| | | | | 1.321.000 | Hua Hong Semiconductor Ltd [^] | 4.274.644 | 0,96 |
| | | | | 12.073.673 2,70 | | | |
| STAMMAKTIE UND VORZUGSAKTIE | | | | Ungarn | | | |
| Argentinien | | | | 243.032 | OTP Bank Nyrt | 7.587.030 | 1,70 |
| 493.036 | Grupo Financiero Galicia SA ADR | 5.719.218 | 1,28 | 7.587.030 1,70 | | | |
| 420.703 | YPF SA ADR [^] | 4.695.045 | 1,05 | Indien | | | |
| 10.414.263 2,33 | | | | 461.136 | Aurobindo Pharma Ltd | 3.663.977 | 0,82 |
| Bermuda | | | | 1.858.177 | Bandhan Bank Ltd | 5.985.650 | 1,34 |
| 8.666.200 | China Gas Holdings Ltd | 9.823.378 | 2,20 | 1.338.927 | ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd | 7.548.183 | 1,69 |
| 9.823.378 2,20 | | | | 583.810 | Mahindra & Mahindra Ltd | 9.287.962 | 2,08 |
| Brasilien | | | | 54.731 | Maruti Suzuki India Ltd | 6.168.921 | 1,38 |
| 1.701.956 | Ambev SA | 4.815.639 | 1,08 | 1.792.822 | Zee Entertainment Enterprises Ltd | 4.230.035 | 0,94 |
| 1.200.227 | Americanas SA | 255.410 | 0,06 | 36.884.728 8,25 | | | |
| 479.437 | Banco Bradesco SA ADR [^] | 1.491.049 | 0,33 | Indonesien | | | |
| 5.123.574 | BRF SA | 8.056.140 | 1,80 | 43.630.400 | Astra International Tbk PT | 18.773.588 | 4,20 |
| 11.779.488 | Raizen SA (Pref) (Pref) | 8.541.327 | 1,91 | 18.773.588 4,20 | | | |
| 23.159.565 5,18 | | | | Israel | | | |
| Kanada | | | | 877.421 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | 6.238.463 | 1,39 |
| 749.514 | Barrick Gold Corp | 12.651.796 | 2,83 | 6.238.463 1,39 | | | |
| 12.651.796 2,83 | | | | Jersey | | | |
| Kaimaninseln | | | | 70.114 | Wizz Air Holdings Plc | 2.437.178 | 0,54 |
| 191.300 | Alibaba Group Holding Ltd | 1.902.268 | 0,43 | 2.437.178 0,54 | | | |
| 331.450 | Baidu Inc 'A' | 5.051.747 | 1,13 | Niederlande | | | |
| 17.714 | Baidu Inc ADR [^] | 2.154.199 | 0,48 | 308.015 | X5 Retail Group NV GDR [†] | 3.080 | 0,00 |
| 1.202.000 | CK Hutchison Holdings Ltd | 7.265.134 | 1,62 | 3.080 0,00 | | | |
| 34.832 | Dlocal Ltd/Uruguay | 414.501 | 0,09 | Philippinen | | | |
| 2.734.000 | Haidilao International Holding Ltd | 5.751.418 | 1,29 | 1.191.195 | ACEN Corp | 124.295 | 0,03 |
| 4.429.500 | JS Global Lifestyle Co Ltd | 4.138.901 | 0,92 | 912.460 | Ayala Corp | 10.723.355 | 2,39 |
| 242.961 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | 2.582.675 | 0,58 | 10.847.650 2,42 | | | |
| 111.020 | Pagseguro Digital Ltd 'A' | 1.103.539 | 0,25 | Polen | | | |
| 28.781.000 | Sunac China Holdings Ltd [^] | 4.371.918 | 0,98 | 260.297 | Bank Polska Kasa Opieki SA | 5.948.035 | 1,33 |
| 1.110.100 | Sunny Optical Technology Group Co Ltd | 10.429.395 | 2,33 | 171.274 | KGHM Polska Miedz SA | 4.291.526 | 0,96 |
| 187.908 | TAL Education Group ADR | 1.036.313 | 0,23 | 10.239.561 2,29 | | | |
| 10.965.000 | TopSports International Holdings Ltd | 8.510.036 | 1,90 | Russland | | | |
| 7.975.200 | Wynn Macau Ltd | 6.820.804 | 1,52 | 213.200 | Lukoil OAO [†] | 26 | 0,00 |
| 61.532.848 13,75 | | | | 253.818 | Magnit PJSC [†] | 32 | 0,00 |
| China | | | | 3 | Magnit PJSC GDR [†] | — | 0,00 |
| 28.660.000 | China Construction Bank Corp 'H' | 18.328.761 | 4,09 | 2.971.692 | Sberbank of Russia PJSC [†] | 366 | 0,00 |
| 2.177.000 | Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A' | 7.376.918 | 1,65 | 424 0,00 | | | |
| 1.679.884 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A' | 6.788.005 | 1,52 | Südafrika | | | |
| 3.074.048 | Shenzhen H&T Intelligent Control Co Ltd 'A' | 6.889.807 | 1,54 | 951.859 | Sibanye Stillwater Ltd [^] | 1.698.371 | 0,38 |
| 39.383.491 8,80 | | | | 1.698.371 0,38 | | | |
| Kolumbien | | | | Südkorea | | | |
| 743.122 | Ecopetrol SA ADR | 6.725.254 | 1,50 | 191.268 | Fila Holdings Corp | 5.238.344 | 1,17 |
| 6.725.254 1,50 | | | | 16.696 | Korea Zinc Co Ltd | 6.044.398 | 1,35 |
| Zypern | | | | 612.661 | Samsung Electronics Co Ltd | 32.958.369 | 7,37 |
| 261.721 | Ozon Holdings Plc ADR [†] | 2.617 | 0,00 | 3.050 | Samsung Electronics Co Ltd GDR | 4.120.550 | 0,92 |
| 266.311 | TCS Group Holding Plc GDR [†] | 2.663 | 0,00 | 146.780 | SK Hynix Inc | 12.010.027 | 2,69 |
| 5.280 0,00 | | | | 60.371.688 13,50 | | | |
| Griechenland | | | | Taiwan | | | |
| 1.046.866 | National Bank of Greece SA | 6.539.077 | 1,46 | 441.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 8.008.396 | 1,79 |
| 6.539.077 1,46 | | | | 158.000 | Wiwynn Corp | 5.964.690 | 1,33 |
| | | | | 13.973.086 3,12 | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|
| Thailand | | | |
| 12.440.300 | PTT PCL NVDR | 10.724.397 | 2,40 |
| 1.127.300 | Siam Cement PCL NVDR | 10.333.583 | 2,31 |
| | | 21.057.980 | 4,71 |
| Türkei | | | |
| 1.071.489 | D-MARKET Elektronik Hizmetler ve Ticaret AS ADR | 1.167.923 | 0,26 |
| | | 1.167.923 | 0,26 |
| Vereinigte Arabische Emirate | | | |
| 7.236.864 | Emaar Properties PJSC | 12.117.430 | 2,71 |
| 61.470 | Fertiglobe Plc | 55.061 | 0,01 |
| | | 12.172.491 | 2,72 |
| Großbritannien | | | |
| 4.170.337 | Ferrexpo Plc | 4.822.139 | 1,08 |
| | | 4.822.139 | 1,08 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 65.759 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | 4.115.527 | 0,92 |
| | | 4.115.527 | 0,92 |
| Gesamt Stammaktien und Vorzugsaktien | | 394.699.532 | 88,23 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 394.699.532 | 88,23 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 305.036 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist)* | 30.511.521 | 6,82 |
| | | 30.511.521 | 6,82 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 30.511.521 | 6,82 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 425.211.053 | 95,05 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 22.158.149 | 4,95 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 447.369.202 | 100,00 |
| * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | |
| ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| † Wertpapier ist ausgesetzt | | | |
| ~ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|---|----------------------------------|---|---|---|----------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Taiwan | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | 678.000 | Accton Technology Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.463.060 |
| Australien | | | | 114.000 | Wiwynn Corp | Bank of America Merrill Lynch | 548.525 |
| (979.791) | Fortescue Metals Group Ltd | HSBC | 1.531.364 | | | | 2.011.585 |
| | | | 1.531.364 | Thailand | | | |
| Brasilien | | | | (3.593.500) | Delta Electronics Thailand PCL NVDR | Goldman Sachs | (1.530.222) |
| 3.253.200 | Americanas SA | Goldman Sachs | (56.528) | (687.000) | Delta Electronics Thailand PCL NVDR | JP Morgan | 8.895 |
| 3.438.752 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao | Bank of America Merrill Lynch | (135.048) | | | | (1.521.327) |
| 1.780.472 | Banco Bradesco SA (Pref) | JP Morgan | (420) | Türkei | | | |
| 3.946.727 | Cielo SA | BNP Paribas | (839.031) | (2.974.675) | Turkiye Garanti Bankasi AS | HSBC | 359.949 |
| 9.622.809 | Hapvida Participacoes e Investimentos SA | Goldman Sachs | 1.409.820 | | | | 359.949 |
| (1.162.589) | WEG SA | Bank of America Merrill Lynch | 650.474 | Vereinigte Arabische Emirate | | | |
| | | | 1.029.267 | (39.746) | International Holding Co PJSC | Goldman Sachs | 1.046 |
| Kaimaninseln | | | | | | | 1.046 |
| (358.463) | NIO Inc ADR | UBS | 354.878 | Großbritannien | | | |
| | | | 354.878 | 1.254.251 | Ferrexpo Plc | HSBC | (144.855) |
| China | | | | (988.160) | Glencore Plc | Goldman Sachs | 353.845 |
| (291.877) | Li Auto Inc ADR | HSBC | (995.301) | (9.465) | State Bank of India Reg GDR | Goldman Sachs | 8.518 |
| | | | (995.301) | (133.341) | State Bank of India Reg GDR | JP Morgan | (26.668) |
| Frankreich | | | | 137.195 | Wizz Air Holdings Plc | HSBC | (591.306) |
| (15.734) | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | HSBC | 1.640.945 | | | | (400.466) |
| | | | 1.640.945 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| Griechenland | | | | 205.718 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | Bank of America Merrill Lynch | (1.952.264) |
| 141.393 | National Bank of Greece SA | HSBC | 72.456 | 227.079 | Bancolumbia SA ADR | Goldman Sachs | (297.473) |
| | | | 72.456 | 200.292 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (35.051) |
| Hongkong | | | | (21.143) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Goldman Sachs | 318.836 |
| 267.900 | Alibaba Group Holding Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (256.456) | (92.623) | Futu Holdings Ltd ADR | HSBC | 453.853 |
| (348.500) | BYD Co Ltd 'H' | Bank of America Merrill Lynch | 393.896 | (8.288) | MercadoLibre Inc | Goldman Sachs | 463.879 |
| 887.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | Citibank | (423.848) | 18.749 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | Goldman Sachs | (35.811) |
| 632.400 | Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A' | HSBC | (126.538) | (83.300) | ON Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (112.038) |
| 463.526 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A' | HSBC | (144.692) | 73.501 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | Morgan Stanley Goldman Sachs | 571.838 |
| 2.369.000 | JS Global Lifestyle Co Ltd | HSBC | 139.787 | (51.637) | Tesla Inc | Goldman Sachs | (1.740.167) |
| (81.700) | Li Auto Inc 'A' | HSBC | (172.834) | 393.011 | XP Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 852.834 |
| 1.861.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | Bank of America Merrill Lynch | (1.975.410) | | | | (1.511.564) |
| 5.428.000 | Sunac China Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (234.951) | Vietnam | | | |
| 1.576.000 | Topsports International Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (182.236) | 3.313.200 | Vietnam Dairy Products JSC | Citibank | (313.321) |
| | | | (2.983.282) | | | | (313.321) |
| Katar | | | | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 294.088.180) | | | |
| 1.360.700 | Dukhan Bank | HSBC | 218.226 | | | | 533.868 |
| | | | 218.226 | | | | |
| Saudi-Arabien | | | | | | | |
| (343.441) | Saudi Arabian Mining Co | Goldman Sachs | 733.716 | | | | |
| 1.251.006 | Yanbu National Petrochemical Co | HSBC | (135.698) | | | | |
| | | | 598.018 | | | | |
| Südafrika | | | | | | | |
| 82.805 | Sibanye Stillwater Ltd | HSBC | (54.533) | | | | |
| | | | (54.533) | | | | |
| Südkorea | | | | | | | |
| 167.979 | Fila Holdings Corp | Citibank | (152.643) | | | | |
| 156.574 | Samsung Electronics Co Ltd | HSBC | 648.571 | | | | |
| | | | 495.928 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (1.804) | INR | Adani Enterprise Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 13.702.224 | (226.472) |
| (2.315) | TRY | BIST 30 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 6.465.628 | (157.778) |
| 242 | USD | MSCI Emerging Markets Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 11.568.810 | 80.465 |
| (100) | INR | State Bank India Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.058.842 | (19.777) |
| Gesamt | | | | | (323.562) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 2.996.088 | USD | 3.382.854 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (95.153) |
| USD | 252.834 | CHF | 226.358 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 4.444 |
| | | | | | | (90.709) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 19.149.016 | USD | 21.181.664 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (719.915) |
| USD | 953.888 | EUR | 878.017 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 15.681 |
| | | | | | | (704.234) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 24.936.048) | | | | | | (794.943) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 19,55 |
| Technologie | 15,98 |
| Zyklische Konsumgüter | 15,64 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 8,55 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 6,82 |
| Grundstoffe | 6,61 |
| Versorger | 5,88 |
| Industrie | 5,52 |
| Energie | 4,95 |
| Kommunikation | 3,24 |
| Diversifiziert | 2,31 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 95,05 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 4,95 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Kaimaninseln Fortsetzung | | | |
| ANLEIHEN | | | | USD 393.000 | IHS Holding Ltd 6,25% 29/11/2028 | 315.673 | 0,03 |
| | Angola | | | USD 1.820.000 | IHS Holding Ltd RegS 5,625% 29/11/2026 [^] | 1.554.116 | 0,16 |
| USD 1.105.000 | Angolan Government International Bond RegS 8,00% 26/11/2029 | 944.405 | 0,10 | USD 8.830.000 | Liberty Costa Rica Senior Secured Finance RegS 10,875% 15/1/2031 [^] | 8.401.544 | 0,85 |
| | | 944.405 | 0,10 | USD 262.000 | MAF Global Securities Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 255.654 | 0,03 |
| | Argentinien | | | USD 9.194.000 | MAF Global Securities Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 9.316.924 | 0,94 |
| USD 8 | Argentine Republic Government International Bond 1,00% 9/7/2029 [^] | 2 | 0,00 | USD 2.315.000 | MAF Sukuk Ltd RegS 4,638% 14/5/2029 | 2.292.521 | 0,23 |
| | | 2 | 0,00 | USD 932.000 | Oryx Funding Ltd 5,80% 3/2/2031 | 902.968 | 0,09 |
| | Österreich | | | USD 636.000 | Sands China Ltd 4,30% 8/1/2026 | 595.093 | 0,06 |
| USD 393.000 | Klabn Austria GmbH 3,20% 12/1/2031 | 311.826 | 0,03 | USD 9.230.000 | Saudi Electricity Sukuk Programme Co RegS 5,684% 11/4/2053 | 9.163.083 | 0,92 |
| USD 3.005.000 | Suzano Austria GmbH 3,75% 15/1/2031 [^] | 2.552.370 | 0,26 | | | 37.474.597 | 3,78 |
| USD 535.000 | Suzano Austria GmbH 3,125% 15/1/2032 | 424.009 | 0,04 | Chile | | | |
| | | 3.288.205 | 0,33 | USD 717.000 | Chile Government International Bond 4,34% 7/3/2042 | 633.520 | 0,06 |
| | Bahamas | | | USD 1.392.000 | Engie Energia Chile SA RegS 3,40% 28/1/2030 | 1.144.147 | 0,12 |
| USD 537.000 | Intercorp Peru Ltd 3,875% 15/8/2029 | 456.079 | 0,05 | | | 1.777.667 | 0,18 |
| | | 456.079 | 0,05 | Kolumbien | | | |
| | Bahrain | | | USD 1.130.000 | Colombia Government International Bond 4,50% 28/1/2026 | 1.076.675 | 0,11 |
| USD 443.000 | Bahrain Government International Bond RegS 5,45% 16/9/2032 | 388.486 | 0,04 | USD 572.000 | Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027 | 518.744 | 0,05 |
| USD 15.715.000 | Bahrain Government International Bond RegS 7,75% 18/4/2035 [^] | 15.538.206 | 1,57 | USD 2.772.000 | Colombia Government International Bond 4,50% 15/3/2029 | 2.419.589 | 0,25 |
| | | 15.926.692 | 1,61 | USD 4.514.000 | Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031 | 3.366.406 | 0,34 |
| | Benin | | | USD 3.696.000 | Colombia Government International Bond 3,25% 22/4/2032 | 2.691.875 | 0,27 |
| EUR 3.652.000 | Benin Government International Bond RegS 4,95% 22/1/2035 [^] | 2.687.014 | 0,27 | USD 2.579.000 | Colombia Government International Bond 8,00% 20/4/2033 | 2.600.019 | 0,26 |
| | | 2.687.014 | 0,27 | USD 4.370.000 | Colombia Government International Bond 7,50% 2/2/2034 | 4.206.158 | 0,43 |
| | Brasilien | | | COP 87.500.000.000 | Colombian TES 7,50% 26/8/2026 | 18.265.430 | 1,84 |
| USD 1.718.000 | Banco do Brasil SA RegS 6,25% 18/4/2030 [^] | 1.708.980 | 0,17 | COP 76.000.100.000 | Colombian TES 5,75% 3/11/2027 | 14.379.126 | 1,45 |
| BRL 55.673.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,00% 1/1/2025 | 11.187.962 | 1,13 | COP 70.060.700.000 | Colombian TES 7,00% 26/3/2031 | 12.720.003 | 1,28 |
| USD 7.749.000 | Brazilian Government International Bond 6,00% 20/10/2033 | 7.617.267 | 0,77 | COP 53.525.000.000 | Colombian TES 7,00% 30/6/2032 | 9.440.071 | 0,95 |
| USD 1.887.000 | BRF SA RegS 4,875% 24/1/2030 [^] | 1.515.167 | 0,15 | COP 75.260.200.000 | Colombian TES 7,25% 18/10/2034 | 12.955.127 | 1,31 |
| | | 22.029.376 | 2,22 | USD 12.484.000 | Ecopetrol SA 4,125% 16/1/2025 | 11.984.640 | 1,21 |
| | Bulgarien | | | USD 524.000 | Ecopetrol SA 4,625% 2/11/2031 | 396.590 | 0,04 |
| EUR 4.870.000 | Bulgaria Government International Bond RegS 4,50% 27/1/2033 | 5.096.970 | 0,51 | USD 2.056.000 | Ecopetrol SA 8,875% 13/1/2033 | 2.003.122 | 0,20 |
| | | 5.096.970 | 0,51 | USD 1.304.000 | Ecopetrol SA 5,875% 28/5/2045 | 854.834 | 0,09 |
| | Kaimaninseln | | | | | | |
| USD 2.845.106 | ABRA Global Finance RegS 11,50% 2/3/2028 | 2.308.775 | 0,23 | | | | |
| USD 1.839.000 | CK Hutchison International 23 Ltd 4,75% 21/4/2028 | 1.847.432 | 0,19 | | | | |
| USD 524.000 | DP World Salaam RegS FRN (Perpetual) | 520.814 | 0,05 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-----------------|--|------------------------|--------------------|-------------------|---|------------------------|--------------------|
| | Kolumbien Fortsetzung | | | | Ägypten Fortsetzung | | |
| USD 681.000 | SURA Asset Management SA RegS 4,875% 17/4/2024 | 672.983 | 0,07 | USD 19.400.000 | Egypt Government International Bond RegS 7,903% 21/2/2048 [*] | 9.606.880 | 0,97 |
| | | 100.551.392 | 10,15 | EUR 3.077.000 | Egypt Government International Bond RegS (traded in International) 6,375% 11/4/2031 | 1.750.061 | 0,18 |
| | Tschechische Republik | | | EUR 134.000 | Egypt Government International Bond RegS (traded in United Kingdom) 6,375% 11/4/2031 | 76.213 | 0,01 |
| CZK 194.570.000 | Czech Republic Government Bond 5,00% 30/9/2030 | 8.973.566 | 0,91 | | | 17.873.209 | 1,80 |
| CZK 147.100.000 | Czech Republic Government Bond RegS 0,95% 15/5/2030 | 5.207.641 | 0,52 | | El Salvador | | |
| CZK 357.110.000 | Czech Republic Government Bond RegS 4,20% 4/12/2036 | 15.524.652 | 1,57 | USD 1.851.000 | El Salvador Government International Bond RegS 7,65% 15/6/2035 | 985.060 | 0,10 |
| | | 29.705.859 | 3,00 | | | 985.060 | 0,10 |
| | Dominikanische Republik | | | | Gabun | | |
| USD 1.415.000 | Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA 6,75% 30/3/2029 | 1.390.459 | 0,14 | USD 6.221.000 | Gabon Government International Bond RegS 7,00% 24/11/2031 | 4.881.790 | 0,49 |
| USD 1.282.000 | Dominican Republic International Bond 5,50% 22/2/2029 | 1.198.121 | 0,12 | | | 4.881.790 | 0,49 |
| USD 749.000 | Dominican Republic International Bond 4,50% 30/1/2030 | 649.912 | 0,07 | | Ghana | | |
| USD 1.071.000 | Dominican Republic International Bond 4,875% 23/9/2032 | 907.766 | 0,09 | USD 943.000 | Ghana Government International Bond RegS 6,375% 11/2/2027 | 383.485 | 0,04 |
| USD 467.000 | Dominican Republic International Bond RegS 6,875% 29/1/2026 | 472.673 | 0,05 | USD 5.450.000 | Ghana Government International Bond RegS 7,625% 16/5/2029 | 2.207.999 | 0,22 |
| USD 656.000 | Dominican Republic International Bond RegS 5,95% 25/1/2027 | 645.112 | 0,06 | USD 1.710.000 | Ghana Government International Bond RegS 8,625% 7/4/2034 | 693.243 | 0,07 |
| USD 1.969.000 | Dominican Republic International Bond RegS 7,05% 3/2/2031 [*] | 1.959.155 | 0,20 | USD 2.626.000 | Ghana Government International Bond RegS 8,95% 26/3/2051 | 1.008.535 | 0,10 |
| USD 5.825.000 | Dominican Republic International Bond RegS 5,30% 21/1/2041 | 4.542.714 | 0,46 | | | 4.293.262 | 0,43 |
| USD 1.358.000 | Dominican Republic International Bond RegS 6,40% 5/6/2049 [*] | 1.129.309 | 0,11 | USD 342.000 | Guatemala Guatemala Government Bond 5,25% 10/8/2029 | 327.885 | 0,03 |
| USD 1.180.000 | Dominican Republic International Bond RegS 5,875% 30/1/2060 | 881.342 | 0,09 | USD 625.000 | Guatemala Government Bond RegS 3,70% 7/10/2033 | 509.897 | 0,05 |
| | | 13.776.563 | 1,39 | | | 837.782 | 0,08 |
| | Ecuador | | | | Ungarn | | |
| USD 4.984.327 | Ecuador Government International Bond RegS 2,50% 31/7/2035 | 1.753.100 | 0,18 | HUF 4.732.370.000 | Hungary Government Bond 4,50% 23/3/2028 [*] | 11.395.161 | 1,15 |
| | | 1.753.100 | 0,18 | USD 696.000 | Hungary Government International Bond 5,25% 16/6/2029 | 676.262 | 0,07 |
| | Ägypten | | | EUR 15.085.000 | Hungary Government International Bond RegS 5,00% 22/2/2027 [*] | 16.167.286 | 1,63 |
| USD 347.000 | Egypt Government International Bond 8,50% 31/1/2047 | 176.889 | 0,02 | USD 2.564.000 | Hungary Government International Bond RegS 5,50% 16/6/2034 | 2.458.357 | 0,25 |
| USD 393.000 | Egypt Government International Bond 7,50% 16/2/2061 | 188.731 | 0,02 | | | 30.697.066 | 3,10 |
| USD 3.876.000 | Egypt Government International Bond RegS 5,25% 6/10/2025 [*] | 2.824.422 | 0,28 | | Indonesien | | |
| USD 3.158.000 | Egypt Government International Bond RegS 7,053% 15/1/2032 [*] | 1.745.798 | 0,17 | USD 2.335.000 | Freeport Indonesia PT RegS 4,763% 14/4/2027 [*] | 2.285.727 | 0,23 |
| USD 2.944.000 | Egypt Government International Bond RegS 8,50% 31/1/2047 | 1.504.215 | 0,15 | USD 2.873.000 | Indonesia Government International Bond 4,10% 24/4/2028 | 2.811.182 | 0,28 |
| | | | | USD 3.486.000 | Indonesia Government International Bond 4,30% 31/3/2052 | 2.996.147 | 0,30 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------|--|------------------------|--------------------|-------------------|--|------------------------|--------------------|
| | Indonesien Fortsetzung | | | | Jordanien Fortsetzung | | |
| IDR 198.048.000.000 | Indonesia Treasury Bond 6,375% 15/8/2028 | 13.430.006 | 1,36 | USD 2.214.000 | Jordan Government International Bond RegS 5,85% 7/7/2030 | 1.986.440 | 0,20 |
| IDR 93.590.000.000 | Indonesia Treasury Bond 9,00% 15/3/2029 | 7.089.489 | 0,72 | | | 11.911.316 | 1,20 |
| IDR 143.363.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029 | 10.534.646 | 1,06 | | Kenia | | |
| IDR 266.847.000.000 | Indonesia Treasury Bond 7,00% 15/9/2030 | 18.469.230 | 1,86 | USD 1.232.000 | Republic of Kenya Government International Bond RegS 8,00% 22/5/2032 [^] | 994.594 | 0,10 |
| IDR 240.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond 7,50% 15/5/2038 | 17.267.512 | 1,74 | | | 994.594 | 0,10 |
| USD 643.000 | Pertamina Persero PT RegS 3,65% 30/7/2029 | 598.382 | 0,06 | | Luxemburg | | |
| USD 364.000 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,40% 6/6/2027 | 362.360 | 0,04 | USD 262.000 | Atento Luxco 1 SA 8,00% 10/2/2026 | 46.526 | 0,00 |
| | | 75.844.681 | 7,65 | USD 773.000 | EIG Pearl Holdings Sarl 3,545% 31/8/2036 [^] | 659.334 | 0,07 |
| | International | | | USD 1.889.000 | EIG Pearl Holdings Sarl RegS 3,545% 31/8/2036 [^] | 1.613.017 | 0,16 |
| USD 1.020.000 | Promigas SA ESP / Gases del Pacifico SAC 3,75% 16/10/2029 | 835.872 | 0,08 | USD 4.004.000 | Kenbourne Invest SA 6,875% 26/11/2024 | 3.255.132 | 0,33 |
| | | 835.872 | 0,08 | USD 767.000 | Kenbourne Invest SA 4,70% 22/1/2028 | 542.192 | 0,05 |
| | Irland | | | USD 253.158 | MC Brazil Downstream Trading SARL 7,25% 30/6/2031 | 185.235 | 0,02 |
| USD 393.000 | ASG Finance Designated Activity Co 7,875% 3/12/2024 | 383.764 | 0,04 | USD 2.393.405 | MC Brazil Downstream Trading SARL RegS 7,25% 30/6/2031 | 1.752.882 | 0,18 |
| | | 383.764 | 0,04 | USD 2.860.200 | Millicom International Cellular SA RegS 5,125% 15/1/2028 | 2.470.119 | 0,25 |
| | Isle of Man | | | USD 524.000 | Puma International Financing SA 5,125% 6/10/2024 [^] | 517.733 | 0,05 |
| USD 2.146.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc 3,75% 1/10/2030 | 1.840.272 | 0,19 | USD 555.294 | Tierra Mojada Luxembourg II Sarl RegS 5,75% 1/12/2040 | 476.228 | 0,05 |
| | | 1.840.272 | 0,19 | | | 11.518.398 | 1,16 |
| | Israel | | | | Mauritius | | |
| USD 1.247.000 | Bank Leumi Le-Israel BM RegS FRN 18/7/2033 | 1.227.625 | 0,13 | USD 965.000 | Diamond II Ltd 7,95% 28/7/2026 | 942.979 | 0,09 |
| USD 127.600 | Leviathan Bond Ltd RegS 5,75% 30/6/2023 | 127.279 | 0,01 | USD 2.353.000 | HTA Group Ltd 7,00% 18/12/2025 | 2.187.725 | 0,22 |
| | | 1.354.904 | 0,14 | USD 262.000 | India Green Energy Holdings 5,375% 29/4/2024 | 254.592 | 0,03 |
| | Elfenbeinküste | | | | | 3.385.296 | 0,34 |
| USD 1.224.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS 6,375% 3/3/2028 | 1.177.170 | 0,12 | | Mexiko | | |
| EUR 2.531.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS 4,875% 30/1/2032 | 2.053.077 | 0,21 | USD 2.892.000 | Alfa SAB de CV 6,875% 25/3/2044 | 2.822.214 | 0,28 |
| EUR 1.946.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS 6,875% 17/10/2040 | 1.518.512 | 0,15 | USD 585.000 | Alpek SAB de CV 3,25% 25/2/2031 [^] | 470.050 | 0,05 |
| EUR 2.115.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS 6,625% 22/3/2048 | 1.537.642 | 0,16 | USD 328.000 | Banco Mercantil del Norte SA FRN 31/12/2099 | 279.706 | 0,03 |
| USD 3.325.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS (traded in Germany) 6,125% 15/6/2033 | 2.889.101 | 0,29 | USD 4.085.000 | Banco Mercantil del Norte SA FRN 31/12/2099 | 3.838.709 | 0,39 |
| USD 1.497.000 | Ivory Coast Government International Bond RegS (traded in Luxembourg) 6,125% 15/6/2033 [^] | 1.300.747 | 0,13 | USD 3.204.000 | Braskem Idesa SAPI 6,99% 20/2/2032 | 2.198.599 | 0,22 |
| | | 10.476.249 | 1,06 | USD 1.332.000 | Cemex SAB de CV 3,875% 11/7/2031 [^] | 1.107.304 | 0,11 |
| | Jordanien | | | USD 1.501.000 | Cemex SAB de CV RegS 5,45% 19/11/2029 [^] | 1.445.206 | 0,14 |
| USD 1.037.000 | Jordan Government International Bond RegS 4,95% 7/7/2025 | 992.559 | 0,10 | USD 3.692.000 | Comision Federal de Electricidad RegS 4,875% 15/1/2024 | 3.653.972 | 0,37 |
| USD 9.035.000 | Jordan Government International Bond RegS 7,50% 13/1/2029 | 8.932.317 | 0,90 | MXN 573.000.000 | Mexican Bonos 7,50% 3/6/2027 | 30.648.594 | 3,09 |
| | | | | MXN 1.068.263.200 | Mexican Bonos 8,50% 31/5/2029 | 59.526.523 | 6,01 |
| | | | | MXN 223.500.000 | Mexican Bonos 8,50% 18/11/2038 | 12.125.915 | 1,22 |
| | | | | MXN 8.160.679.000 | Mexico Cetes 23/1/2025 (Zero Coupon) | 38.926.342 | 3,93 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------------|---|------------------------|--------------------|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Mexiko Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| USD 3.315.000 | Mexico City Airport Trust RegS 5,50% 31/7/2047 | 2.553.130 | 0,26 | USD 376.000 | MEGlobal BV 2,625% 28/4/2028 | 330.542 | 0,03 |
| USD 616.000 | Mexico Government International Bond 3,75% 11/1/2028 | 589.604 | 0,06 | USD 1.991.000 | MEGlobal BV RegS 4,25% 3/11/2026 | 1.930.573 | 0,19 |
| USD 1.928.000 | Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031 | 1.604.930 | 0,16 | USD 1.314.000 | MEGlobal BV RegS 2,625% 28/4/2028 | 1.155.702 | 0,12 |
| USD 275.000 | Mexico Government International Bond 4,875% 19/5/2033 | 263.165 | 0,03 | USD 1.325.000 | Metinvest BV RegS 8,50% 23/4/2026 | 871.519 | 0,09 |
| USD 200.000 | Mexico Government International Bond 6,35% 9/2/2035 | 211.105 | 0,02 | USD 937.000 | Metinvest BV RegS 7,65% 1/10/2027 | 573.716 | 0,06 |
| USD 8.609.000 | Mexico Government International Bond 4,40% 12/2/2052 [^] | 6.666.576 | 0,67 | USD 4.878.000 | Vivo Energy Investments BV 5,125% 24/9/2027 | 4.421.907 | 0,44 |
| USD 4.700.000 | Mexico Government International Bond 6,338% 4/5/2053 [^] | 4.721.150 | 0,48 | | | 11.492.353 | 1,16 |
| USD 1.254.000 | Petroleos Mexicanos 4,25% 15/1/2025 | 1.177.942 | 0,12 | Nigeria | | | |
| USD 41.000 | Petroleos Mexicanos 6,875% 16/10/2025 | 39.548 | 0,00 | USD 422.000 | Nigeria Government International Bond 8,375% 24/3/2029 | 367.212 | 0,04 |
| USD 4.101.000 | Petroleos Mexicanos 6,50% 13/3/2027 | 3.557.617 | 0,36 | USD 4.747.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,875% 16/2/2032 | 3.739.971 | 0,38 |
| USD 11.921.000 | Petroleos Mexicanos 8,75% 2/6/2029 | 10.603.521 | 1,07 | USD 2.697.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,375% 28/9/2033 | 1.990.609 | 0,20 |
| USD 11.509.000 | Petroleos Mexicanos 6,84% 23/1/2030 | 8.965.511 | 0,90 | USD 2.853.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,625% 28/11/2047 [^] | 1.880.890 | 0,19 |
| USD 4.610.000 | Petroleos Mexicanos 5,95% 28/1/2031 [^] | 3.311.964 | 0,33 | USD 2.677.000 | Nigeria Government International Bond RegS 9,248% 21/1/2049 [^] | 2.039.673 | 0,20 |
| USD 906.000 | Petroleos Mexicanos 6,70% 16/2/2032 | 678.367 | 0,07 | USD 1.743.000 | Nigeria Government International Bond RegS 8,25% 28/9/2051 | 1.185.837 | 0,12 |
| USD 3.000.000 | Petroleos Mexicanos 5,50% 27/6/2044 [^] | 1.658.085 | 0,17 | | | 11.204.192 | 1,13 |
| USD 1.456.000 | Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047 | 882.187 | 0,09 | Oman | | | |
| USD 5.764.000 | Petroleos Mexicanos 6,95% 28/1/2060 | 3.440.532 | 0,35 | USD 7.406.000 | Oman Government International Bond RegS 6,50% 8/3/2047 | 6.777.804 | 0,68 |
| EUR 6.872.000 | Petroleos Mexicanos RegS 3,75% 21/2/2024 [^] | 7.207.206 | 0,73 | USD 7.322.000 | Oman Government International Bond RegS 6,75% 17/1/2048 | 6.903.493 | 0,70 |
| USD 7.815.000 | Petroleos Mexicanos RegS 10,00% 7/2/2033 [^] | 7.006.480 | 0,71 | USD 950.000 | OQ SAOC 5,125% 6/5/2028 | 893.461 | 0,09 |
| USD 434.000 | Trust Fibra Uno 5,25% 30/1/2026 | 416.922 | 0,04 | | | 14.574.758 | 1,47 |
| | | 222.598.676 | 22,46 | Pakistan | | | |
| USD 1.070.000 | Morocco Government International Bond 5,95% 8/3/2028 | 1.085.103 | 0,11 | USD 2.619.000 | Pakistan Government International Bond RegS 6,875% 5/12/2027 | 997.106 | 0,10 |
| USD 324.000 | Morocco Government International Bond RegS 2,375% 15/12/2027 | 284.507 | 0,03 | | | 997.106 | 0,10 |
| USD 2.703.000 | Morocco Government International Bond RegS 3,00% 15/12/2032 | 2.135.137 | 0,21 | Panama | | | |
| USD 8.126.000 | Morocco Government International Bond RegS 6,50% 8/9/2033 | 8.298.840 | 0,84 | USD 3.007.000 | Aeropuerto Internacional de Tocumen SA 5,125% 11/8/2061 | 2.267.879 | 0,23 |
| USD 1.398.000 | OCP SA RegS 5,125% 23/6/2051 | 1.010.855 | 0,10 | USD 2.162.000 | Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030 | 1.908.306 | 0,19 |
| | | 12.814.442 | 1,29 | USD 6.881.000 | Panama Government International Bond 6,40% 14/2/2035 | 7.212.750 | 0,73 |
| USD 2.018.000 | Braskem Netherlands Finance BV 7,25% 13/2/2033 | 1.946.280 | 0,20 | USD 5.876.000 | Panama Government International Bond 4,50% 16/4/2050 | 4.498.313 | 0,45 |
| USD 262.000 | Braskem Netherlands Finance BV FRN 23/1/2081 | 262.114 | 0,03 | | | 15.887.248 | 1,60 |
| | | | | Paraguay | | | |
| | | | | USD 3.479.000 | Paraguay Government International Bond RegS 3,849% 28/6/2033 [^] | 3.012.765 | 0,30 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-----------------|--|------------------------|--------------------|-----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Paraguay Fortsetzung | | | | Saudi-Arabien Fortsetzung | | |
| USD 555.000 | Paraguay Government International Bond RegS 5,60% 13/3/2048 | 480.623 | 0,05 | USD 807.000 | Saudi Government International Bond RegS 4,50% 17/4/2030 | 801.601 | 0,08 |
| | | 3.493.388 | 0,35 | USD 551.000 | Saudi Government International Bond RegS 2,25% 2/2/2033 | 448.809 | 0,05 |
| | Peru | | | USD 4.135.000 | Saudi Government International Bond RegS 5,00% 18/1/2053 | 3.802.567 | 0,38 |
| USD 2.364.000 | Corp Financiera de Desarrollo SA RegS 4,75% 15/7/2025 | 2.306.973 | 0,23 | | | 7.041.163 | 0,71 |
| USD 731.000 | Peruvian Government International Bond 2,392% 23/1/2026 | 686.548 | 0,07 | | Senegal | | |
| USD 187.000 | Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031 | 159.566 | 0,02 | EUR 2.586.000 | Senegal Government International Bond RegS 4,75% 13/3/2028* | 2.272.082 | 0,23 |
| USD 3.946.000 | Peruvian Government International Bond 1,862% 1/12/2032* | 2.989.065 | 0,30 | USD 2.678.000 | Senegal Government International Bond RegS 6,25% 23/5/2033 | 2.140.525 | 0,22 |
| | | 6.142.152 | 0,62 | EUR 1.774.000 | Senegal Government International Bond RegS 5,375% 8/6/2037* | 1.181.069 | 0,12 |
| | Polen | | | USD 4.976.000 | Senegal Government International Bond RegS 6,75% 13/3/2048* | 3.320.933 | 0,33 |
| USD 3.855.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego RegS 5,375% 22/5/2033 | 3.867.047 | 0,39 | | | 8.914.609 | 0,90 |
| USD 1.101.000 | Republic of Poland Government International Bond 4,875% 4/10/2033 | 1.099.280 | 0,11 | USD 3.922.740 | Singapur Continuum Energy Levanter Pte Ltd RegS 4,50% 9/2/2027* | 3.523.385 | 0,36 |
| USD 1.684.000 | Republic of Poland Government International Bond 5,50% 4/4/2053 | 1.695.076 | 0,17 | | | 3.523.385 | 0,36 |
| EUR 12.638.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 4,25% 14/2/2043 | 13.038.657 | 1,32 | | Südafrika | | |
| | | 19.700.060 | 1,99 | ZAR 973.170.000 | Republic of South Africa Government Bond 8,00% 31/1/2030* | 41.940.089 | 4,23 |
| | Rumänien | | | ZAR 53.326.639 | Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035 | 2.118.383 | 0,21 |
| USD 692.000 | Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027 | 680.423 | 0,07 | USD 570.000 | Republic of South Africa Government International Bond 4,85% 30/9/2029 | 492.856 | 0,05 |
| EUR 719.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,875% 11/3/2029* | 662.935 | 0,07 | USD 4.190.000 | Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 22/6/2030 | 3.772.278 | 0,38 |
| EUR 756.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,50% 8/2/2030 | 655.679 | 0,07 | USD 551.000 | Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 20/4/2032 | 476.116 | 0,05 |
| EUR 2.194.000 | Romanian Government International Bond RegS 3,624% 26/5/2030* | 2.024.114 | 0,20 | USD 911.000 | Republic of South Africa Government International Bond 5,00% 12/10/2046 | 583.969 | 0,06 |
| USD 6.970.000 | Romanian Government International Bond RegS 3,00% 14/2/2031* | 5.773.268 | 0,58 | USD 2.670.000 | Transnet SOC Ltd RegS 8,25% 6/2/2028 | 2.559.896 | 0,26 |
| EUR 763.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,124% 16/7/2031 | 606.309 | 0,06 | | | 51.943.587 | 5,24 |
| | | 10.402.728 | 1,05 | | Südkorea | | |
| | Russland | | | USD 5.857.000 | POSCO 5,625% 17/1/2026 | 5.897.775 | 0,60 |
| RUB 967.119.000 | Russian Federal Bond - OFZ 6,10% 18/7/2035 | 714.829 | 0,07 | USD 744.000 | POSCO 5,75% 17/1/2028 | 765.818 | 0,08 |
| | | 714.829 | 0,07 | USD 1.697.000 | POSCO 5,875% 17/1/2033* | 1.811.769 | 0,18 |
| | Ruanda | | | | | 8.475.362 | 0,86 |
| USD 1.337.000 | Rwanda International Government Bond RegS 5,50% 9/8/2031 | 986.412 | 0,10 | | Spanien | | |
| | | 986.412 | 0,10 | USD 309.808 | Al Candelaria Spain SA RegS 7,50% 15/12/2028 | 283.379 | 0,03 |
| | Saudi-Arabien | | | | | 283.379 | 0,03 |
| USD 2.162.000 | Saudi Government International Bond 5,00% 18/1/2053 | 1.988.186 | 0,20 | | Schweden | | |
| | | | | EUR 6.082.382 | East Renewable AB RegS 13,50% 1/1/2025 | 974.169 | 0,10 |
| | | | | | | 974.169 | 0,10 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|--|--|------------------------|--------------------|
| Ukraine | | | | Uruguay | | | |
| UAH 280.857.000 | Ukraine Government International Bond RegS 16,00% 24/5/2024 | 7.618.668 | 0,77 | USD 2.071.971 | Uruguay Government International Bond 4,375% 23/1/2031* | 2.067.615 | 0,21 |
| USD 942.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2026 | 183.478 | 0,02 | USD 714.000 | Uruguay Government International Bond 5,75% 28/10/2034 | 781.451 | 0,08 |
| USD 2.818.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2027 | 551.518 | 0,06 | | | 2.849.066 | 0,29 |
| USD 2.826.000 | Ukraine Government International Bond RegS 6,876% 21/5/2031 | 523.333 | 0,05 | Venezuela | | | |
| USD 11.921.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,375% 25/9/2034 | 2.227.737 | 0,22 | USD 49.187.000 | Petroleos de Venezuela SA RegS 8,50% 27/10/2023 | 18.322.157 | 1,85 |
| USD 38.269.000 | Ukraine Government International Bond RegS FRN 1/8/2041 | 11.158.379 | 1,13 | USD 298.810.114 | Petroleos de Venezuela SA RegS 9,75% 17/5/2035 | 8.964.303 | 0,90 |
| | | 22.263.113 | 2,25 | USD 9.827.000 | Venezuela Government International Bond 9,25% 15/9/2027 | 869.690 | 0,09 |
| Vereinigte Arabische Emirate | | | | USD 9.983.500 | Venezuela Government International Bond RegS 11,75% 21/10/2026 | 883.540 | 0,09 |
| USD 787.000 | Abu Dhabi National Energy Co PJSC 4,375% 24/1/2029 | 783.065 | 0,08 | USD 2.832.800 | Venezuela Government International Bond RegS 9,25% 7/5/2028 | 250.703 | 0,03 |
| USD 530.000 | Abu Dhabi National Energy Co PJSC 4,696% 24/4/2033 | 529.006 | 0,05 | USD 44.697.400 | Venezuela Government International Bond RegS 11,95% 5/8/2031 | 3.955.720 | 0,40 |
| USD 4.390.000 | Aldar Investment Properties Sukuk Ltd RegS 4,875% 24/5/2033 | 4.354.331 | 0,44 | | | 33.246.113 | 3,36 |
| USD 2.702.000 | MDGH GMTN RSC Ltd 4,375% 22/11/2033 | 2.633.099 | 0,27 | Sambia | | | |
| | | 8.299.501 | 0,84 | USD 5.951.000 | Zambia Government International Bond RegS 5,375% 20/9/2023 | 2.698.526 | 0,27 |
| Großbritannien | | | | | | 2.698.526 | 0,27 |
| USD 2.292.000 | Liquid Telecommunications Financing Plc 5,50% 4/9/2026 | 1.385.326 | 0,14 | Gesamt Anleihen | | 966.104.474 | 97,49 |
| USD 1.922.000 | Vedanta Resources Finance II Plc 8,95% 11/3/2025 | 1.431.410 | 0,14 | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| | | 2.816.736 | 0,28 | Irland | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | USD 60.980 | iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF 'D'^^ | 5.091.501 | 0,51 |
| USD 1.086.000 | DAE Funding LLC RegS 1,55% 1/8/2024 | 1.028.849 | 0,10 | | | 5.091.501 | 0,51 |
| USD 606.000 | DAE Funding LLC RegS 2,625% 20/3/2025 | 573.426 | 0,06 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 5.091.501 | 0,51 |
| USD 286.000 | MercadoLibre Inc 2,375% 14/1/2026^ | 262.341 | 0,03 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| USD 2.557.000 | Sasol Financing USA LLC 4,375% 18/9/2026^ | 2.241.897 | 0,23 | | | 971.195.975 | 98,00 |
| USD 3.850.000 | Sasol Financing USA LLC 6,50% 27/9/2028^ | 3.417.505 | 0,34 | Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| USD 2.739.000 | Sasol Financing USA LLC 8,75% 3/5/2029 | 2.629.262 | 0,26 | ANLEIHEN | | | |
| USD 4.022.000 | Sasol Financing USA LLC 5,50% 18/3/2031 | 3.137.910 | 0,32 | Chile | | | |
| USD 891.000 | SierraCol Energy Andina LLC RegS 6,00% 15/6/2028 | 644.549 | 0,06 | USD 1.100.000 | Empresa Nacional del Petroleo 6,15% 10/5/2033 | 1.098.328 | 0,11 |
| USD 759.000 | Stillwater Mining Co RegS 4,00% 16/11/2026 | 663.644 | 0,07 | | | 1.098.328 | 0,11 |
| USD 26.935.400 | United States Treasury Bill 24/11/2023 (Zero Coupon) | 26.252.617 | 2,65 | Guatemala | | | |
| USD 26.061.500 | United States Treasury Note/ Bond 0,125% 15/10/2023 | 25.556.006 | 2,58 | USD 842.000 | Guatemala Government Bond 4,65% 7/10/2041 | 671.596 | 0,07 |
| USD 1.822.100 | United States Treasury Note/ Bond 2,50% 30/4/2024 | 1.777.979 | 0,18 | | | 671.596 | 0,07 |
| | | 68.185.985 | 6,88 | Gesamt Anleihen | | 1.769.924 | 0,18 |
| | | | | Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| | | | | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| | | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | |
| | | | | ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| | | | | - Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|--------------------|---|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 45.372.600 | Fund receives default protection on Markit CDX.EM.39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (325.400) | 2.815.337 |
| CCCDs | USD 36.845.738 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.40 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (139.781) | (406.139) |
| CCCDs | USD 44.202.200 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Asia Ex-Japan Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (299.264) | 447.416 |
| CCCDs | EUR 42.621.747 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (644.150) | (1.231.338) |
| CCIRS | USD 11.680.000 | Fund receives Fixed 3,132% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 17/4/2033 | (252.219) | (252.018) |
| CCIRS | KRW 59.369.597.428 | Fund receives Fixed 3,188% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | (165.030) | (164.596) |
| CCIRS | KRW 43.881.876.359 | Fund receives Fixed 3,190% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | (119.626) | (119.306) |
| CCIRS | KRW 23.664.300.000 | Fund receives Fixed 3,330% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | 6.526 | 6.701 |
| CCIRS | KRW 23.667.850.000 | Fund receives Fixed 3,380% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | 31.902 | 32.077 |
| CCIRS | KRW 23.667.850.000 | Fund receives Fixed 3,382% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | 33.171 | 33.346 |
| CCIRS | GBP 10.800.873 | Fund receives Fixed 4,486% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 24/5/2028 | 1.145 | 3.468 |
| CCIRS | ZAR 1.075.000.000 | Fund receives Fixed 7,700% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 19/6/2025 | (606.925) | (606.760) |
| CCIRS | MXN 589.595.000 | Fund receives Fixed 8,265% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 6/12/2032 | (170.816) | (170.303) |
| CCIRS | MXN 440.500.000 | Fund receives Fixed 8,350% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 28/4/2028 | (158.896) | (158.655) |
| CCIRS | MXN 309.500.000 | Fund receives Fixed 8,410% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 20/1/2028 | (96.502) | (96.341) |
| CCIRS | MXN 125.588.179 | Fund receives Fixed 8,500% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 24/1/2028 | (14.382) | (14.317) |
| CCIRS | MXN 472.651.762 | Fund receives Fixed 8,725% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2028 | 221.786 | 222.043 |
| CCIRS | EUR 4.265.667 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,640% | Bank of America Merrill Lynch | 31/5/2052 | 877.865 | 878.027 |
| CCIRS | EUR 7.260.766 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,736% | Bank of America Merrill Lynch | 31/5/2032 | 732.679 | 732.812 |
| CCIRS | MXN 738.000.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 9,250% | Bank of America Merrill Lynch | 17/9/2032 | (2.435.416) | (2.434.788) |
| CCIRS | PLN 72.427.100 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 5,531% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (337.380) | (337.084) |
| CCIRS | USD 35.194.553 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 1,404% | Bank of America Merrill Lynch | 5/1/2032 | 5.188.158 | 5.188.763 |
| CCIRS | USD 13.154.267 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,817% | Bank of America Merrill Lynch | 24/5/2028 | 2.214 | (167.910) |
| CCIRS | USD 52.840.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 4,015% | Bank of America Merrill Lynch | 17/4/2025 | 319.399 | 319.650 |
| CCIRS | USD 52.600.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 4,167% | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2025 | 165.872 | 169.518 |
| CCIRS | ZAR 1.880.000.000 | Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 8,205% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2024 | 732.943 | 733.443 |
| CDS | USD 40.000.000 | Fund receives default protection on Chile Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (681.424) | (269.298) |
| CDS | USD 3.200.000 | Fund receives default protection on Turkey Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (62.451) | 619.353 |
| CDS | USD 42.976.561 | Fund receives default protection on Korea International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (116.930) | (1.192.940) |
| CDS | USD 40.000.000 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (494.545) | 277.678 |
| CDS | USD 40.000.000 | Fund receives default protection on Indonesia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/6/2028 | (513.300) | (189.415) |
| CDS | USD 18.681.000 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (69.363) | 129.683 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Marktwert USD |
|--|---------------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | USD 15.319.000 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (56.880) | 106.344 |
| CDS | USD 29.236.761 | Fund receives default protection on Philippine Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (453.260) | (188.125) |
| CDS | USD 7.565.600 | Fund receives default protection on Turkey Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | 113.179 | 1.464.304 |
| CDS | USD 4.920.000 | Fund receives default protection on Turkey Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (23.645) | 952.255 |
| CDS | USD 18.652.561 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Chile Government International Bond | Goldman Sachs | 20/6/2028 | 117.051 | 125.577 |
| CDS | USD 14.847.439 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Chile Government International Bond | Goldman Sachs | 20/6/2028 | 93.173 | 99.960 |
| CDS | USD 15.805.133 | Fund receives default protection on Korea International Bond and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (35.269) | (438.718) |
| CDS | USD 32.927.361 | Fund receives default protection on Korea International Bond and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (79.721) | (913.995) |
| CDS | USD 13.170.945 | Fund receives default protection on Korea International Bond and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (31.888) | (365.598) |
| CDS | USD 3.300.000 | Fund receives default protection on Turkey Government International Bond and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (65.531) | 638.707 |
| CDS | USD 25.194.747 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (728.005) | 1.224.465 |
| CDS | USD 12.124.500 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (350.339) | 589.251 |
| CDS | USD 5.755.600 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (166.309) | 279.722 |
| IRS | BRL 203.213.139 | Fund receives Fixed 13,900% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Bank of America Merrill Lynch | 1/4/2024 | 415.689 | 415.689 |
| IRS | COP 170.744.378.000 | Fund receives Floating COP 12 Month IBRCOL and pays Fixed 11,895% | Bank of America Merrill Lynch | 19/10/2024 | 104.431 | 104.431 |
| IRS | BRL 238.000.000 | Fund receives Fixed 11,745% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Citibank | 2/1/2026 | 1.029.296 | 1.029.296 |
| IRS | BRL 73.622.673 | Fund receives Fixed 11,760% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Citibank | 2/1/2026 | 324.973 | 324.973 |
| IRS | COP 329.255.622.000 | Fund receives Floating COP 12 Month IBRCOL and pays Fixed 12,370% | Citibank | 18/4/2024 | 152.035 | 152.035 |
| IRS | BRL 76.867.051 | Fund receives Fixed 11,775% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | JP Morgan | 2/1/2026 | 345.240 | 345.240 |
| IRS | BRL 168.551.312 | Fund receives Fixed 11,900% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | JP Morgan | 2/1/2029 | 1.613.172 | 1.613.172 |
| IRS | BRL 96.716.211 | Fund receives Fixed 11,985% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | JP Morgan | 2/1/2025 | 121.300 | 121.300 |
| IRS | BRL 116.026.000 | Fund receives Fixed 12,000% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Morgan Stanley | 2/1/2029 | 1.240.274 | 1.240.274 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 1.498.857.122) | | | | | 4.288.826 | 13.718.666 |

CCDS: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps

CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps

CDS: Credit Default Swaps

IRS: Zinsraten-Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|--|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 27 | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 3.912.417 | 148.759 |
| 21 | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 3.087.612 | (25.490) |
| (116) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 122.980.773 | (686.615) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 77 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 9.195.353 | 131.168 |
| 589 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 67.394.484 | 519.663 |
| 917 | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 188.830.360 | 83.537 |
| 124 | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 13.524.719 | (17.903) |
| 74 | USD | US Ultra Bond Futures September 2023 | September 2023 | 10.082.500 | 116.200 |
| Gesamt | | | | | 269.319 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Marktwert USD |
|---|-----------|-----------------------|-------------------------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 30.360.000 | Call | OTC USD/CLP | Bank of America Merrill Lynch | USD 830,00 | 02/06/2023 | (628.543) | 13.814 |
| 40.507.822 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 128,00 | 22/06/2023 | (128.248) | 8.669 |
| 15.405.000 | Call | OTC USD/ZAR | Goldman Sachs | USD 19,75 | 17/07/2023 | 69.631 | 362.618 |
| 20.420.000 | Put | OTC USD/MXN | HSBC | USD 18,15 | 16/06/2023 | 211.898 | 551.279 |
| 15.335.000 | Put | OTC USD/MXN | HSBC | USD 17,70 | 10/07/2023 | (24.873) | 174.098 |
| 14.295.000 | Put | OTC USD/MXN | HSBC | USD 17,50 | 16/06/2023 | (9.864) | 54.607 |
| 15.215.000 | Put | OTC USD/TBH | JP Morgan | USD 34,25 | 22/06/2023 | (61.256) | 57.269 |
| 38.005.000 | Put | OTC AUD/USD | Morgan Stanley | AUD 0,66 | 16/06/2023 | 191.973 | 459.646 |
| 18.865.000 | Put | OTC EUR/USD | Morgan Stanley | EUR 1,07 | 06/06/2023 | 28.945 | 74.509 |
| 20.205.000 | Put | OTC EUR/USD | Standard Chartered Bank | EUR 1,09 | 01/06/2023 | 303.395 | 417.929 |
| 48.000.000 | Put | OTC EUR/CHF | UBS | EUR 0,95 | 31/05/2023 | (413.238) | — |
| 48.000.000 | Call | OTC EUR/CHF | UBS | EUR 1,05 | 31/05/2023 | (75.364) | — |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 53.743.488) | | | | | | (535.544) | 2.174.438 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|-----------|----------------------------------|-------------------------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (30.360.000) | Call | OTC USD/CLP | Bank of America Merrill Lynch | USD 870,00 | 02/06/2023 | 281.194 | (91) |
| (30.360.000) | Put | OTC USD/CLP | Bank of America Merrill Lynch | USD 780,00 | 02/06/2023 | 301.961 | (61) |
| (1.135) | Put | US Treasury 10 Year Note Futures | Exchange Traded | USD 113,00 | 25/08/2023 | 782.047 | (1.383.281) |
| (471) | Call | US Treasury 5 Year Note Futures | Exchange Traded | USD 110,00 | 23/06/2023 | 89.910 | (161.906) |
| (471) | Put | US Treasury 5 Year Note Futures | Exchange Traded | USD 109,00 | 23/06/2023 | (78.871) | (371.649) |
| (333) | Call | US Treasury 5 Year Note Futures | Exchange Traded | USD 109,25 | 23/06/2023 | — | (223.735) |
| (15.405.000) | Put | OTC USD/ZAR | Goldman Sachs | USD 19,00 | 17/07/2023 | 113.612 | (116.061) |
| (28.590.000) | Put | OTC USD/MXN | HSBC | USD 17,50 | 16/06/2023 | (7.148) | (109.214) |
| (10.223.333) | Call | OTC USD/MXN | HSBC | USD 18,50 | 10/07/2023 | 21.183 | (51.710) |
| (20.500.000) | Put | OTC USD/THB | JP Morgan | USD 34,10 | 31/05/2023 | 526.030 | — |
| (20.500.000) | Put | OTC USD/TWD | JP Morgan | USD 29,85 | 31/05/2023 | 393.477 | — |
| (30.405.000) | Call | OTC AUD/USD | Morgan Stanley | AUD 0,68 | 16/06/2023 | 204.249 | (2.837) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|--|-----------|-----------------------|----------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (10.000.000) | Put | OTC EUR/NZD | Morgan Stanley | EUR 1,73 | 09/08/2023 | 110.838 | (38.321) |
| (20.000.000) | Put | OTC EUR/NZD | Morgan Stanley | EUR 1,72 | 19/10/2023 | 222.498 | (125.994) |
| (48.000.000) | Call | OTC EUR/CHF | UBS | EUR 1,00 | 31/05/2023 | 485.568 | — |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 111.025.199) | | | | | | 3.446.548 | (2.584.860) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 15.407.910 | USD | 10.191.932 | JP Morgan | 13/7/2023 | (193.690) |
| AUD | 23.021.200 | USD | 15.591.195 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (652.665) |
| BRL | 1.219.140 | USD | 244.952 | BNP Paribas | 2/6/2023 | (4.735) |
| BRL | 50.955.000 | USD | 10.231.928 | Citibank | 2/6/2023 | (191.830) |
| BRL | 99.303.256 | USD | 19.463.327 | Goldman Sachs | 2/6/2023 | 103.238 |
| BRL | 29.187.600 | USD | 5.849.429 | HSBC | 2/6/2023 | (98.348) |
| BRL | 50.850.000 | USD | 10.186.910 | JP Morgan | 2/6/2023 | (167.502) |
| BRL | 180.969.617 | USD | 36.160.221 | BNP Paribas | 5/7/2023 | (691.214) |
| CAD | 6.900.000 | USD | 5.118.277 | JP Morgan | 13/7/2023 | (47.061) |
| CHF | 21.949.873 | USD | 24.764.181 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | (600.380) |
| CLP | 11.250.564.600 | USD | 13.812.000 | Bank of America Merrill Lynch | 6/6/2023 | 64.908 |
| CLP | 3.991.926.130 | USD | 4.988.349 | Bank of America Merrill Lynch | 13/7/2023 | (89.218) |
| CLP | 4.050.309.825 | USD | 5.085.709 | BNP Paribas | 13/7/2023 | (114.927) |
| CLP | 7.413.585.000 | USD | 9.277.882 | HSBC | 13/7/2023 | (179.487) |
| CNY | 70.383.335 | USD | 10.219.182 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | (291.447) |
| COP | 16.744.044.651 | USD | 3.623.883 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 147.243 |
| COP | 69.210.025.000 | USD | 15.179.302 | Citibank | 13/7/2023 | 408.314 |
| COP | 48.932.852.900 | USD | 10.753.481 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 267.271 |
| CZK | 586.730.000 | USD | 27.396.078 | HSBC | 13/7/2023 | (1.075.636) |
| EUR | 14.150.000 | USD | 15.250.162 | Morgan Stanley | 8/6/2023 | (136.422) |
| EUR | 14.150.000 | USD | 15.195.827 | BNP Paribas | 13/7/2023 | (50.797) |
| EUR | 9.298.368 | USD | 10.216.775 | Deutsche Bank | 13/7/2023 | (264.545) |
| EUR | 38.953.256 | USD | 42.826.304 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | (1.133.851) |
| EUR | 18.865.000 | USD | 20.389.990 | JP Morgan | 13/7/2023 | (198.401) |
| EUR | 9.185.000 | USD | 9.999.834 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (168.944) |
| GBP | 6.157.076 | USD | 7.667.125 | BNP Paribas | 13/7/2023 | (38.680) |
| GBP | 6.061.564 | USD | 7.574.352 | Citibank | 13/7/2023 | (64.243) |
| GBP | 18.805.335 | USD | 23.729.963 | JP Morgan | 13/7/2023 | (430.678) |
| GBP | 8.170.046 | USD | 10.227.106 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (104.647) |
| HKD | 153.998.199 | USD | 19.767.181 | Goldman Sachs | 15/9/2023 | (56.474) |
| HKD | 156.341.474 | USD | 20.055.864 | HSBC | 15/9/2023 | (45.234) |
| HUF | 3.568.810.000 | USD | 10.134.922 | Bank of America Merrill Lynch | 13/7/2023 | 18.062 |
| HUF | 4.071.647.519 | USD | 11.794.934 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | (211.417) |
| HUF | 1.738.670.000 | USD | 5.042.395 | JP Morgan | 13/7/2023 | (96.016) |
| IDR | 543.154.365.000 | USD | 36.739.337 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | (533.338) |
| INR | 821.444.400 | USD | 9.975.038 | HSBC | 13/7/2023 | (56.049) |
| JPY | 4.374.204.629 | USD | 32.680.331 | HSBC | 13/7/2023 | (1.273.804) |
| KRW | 6.597.935.000 | USD | 4.994.916 | JP Morgan | 13/7/2023 | (4.345) |
| KRW | 13.340.183.283 | USD | 10.072.168 | Standard Chartered Bank | 13/7/2023 | 18.132 |
| MXN | 512.086.812 | USD | 28.468.551 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | 259.700 |
| MXN | 27.450.683 | USD | 1.441.607 | UBS | 31/8/2023 | 84.021 |
| NZD | 8.035.461 | USD | 5.055.674 | JP Morgan | 13/7/2023 | (237.632) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|-------------------------------------|---------------|---------|-----------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| NZD | 8.082.070 | USD | 5.140.003 | Natwest Markets | 13/7/2023 | (294.014) |
| PLN | 161.979.901 | USD | 38.827.993 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (786.342) |
| SGD | 41.235.000 | USD | 31.131.664 | JP Morgan | 13/7/2023 | (631.788) |
| THB | 350.980.000 | USD | 10.190.761 | BNP Paribas | 13/7/2023 | (63.660) |
| THB | 171.013.717 | USD | 5.137.244 | HSBC | 13/7/2023 | (202.851) |
| THB | 1.074.872.199 | USD | 31.849.974 | Standard Chartered Bank | 13/7/2023 | (835.844) |
| TWD | 17.120.563 | USD | 560.613 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (2.134) |
| USD | 4.482.637 | AUD | 6.618.844 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 187.648 |
| USD | 46.455.105 | BRL | 231.514.996 | BNP Paribas | 2/6/2023 | 837.734 |
| USD | 243.601 | BRL | 1.219.140 | BNP Paribas | 5/7/2023 | 4.657 |
| USD | 30.933.385 | CAD | 41.394.487 | JP Morgan | 13/7/2023 | 510.143 |
| USD | 13.812.000 | CLP | 11.250.564.600 | Barclays Bank | 6/6/2023 | (64.908) |
| USD | 10.089.889 | CLP | 8.161.408.328 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 73.720 |
| USD | 9.902.677 | CLP | 8.100.885.000 | Toronto Dominion Bank | 13/7/2023 | (39.214) |
| USD | 12.926.853 | CNY | 89.032.081 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | 368.669 |
| USD | 17.795.290 | COP | 83.230.350.000 | State Street Bank & Trust Company | 5/7/2023 | (990.924) |
| USD | 52.430.789 | COP | 242.254.888.520 | BNP Paribas | 13/7/2023 | (2.130.323) |
| USD | 10.082.060 | COP | 46.498.462.900 | Toronto Dominion Bank | 13/7/2023 | (390.413) |
| USD | 5.015.547 | CZK | 111.449.260 | Morgan Stanley | 7/6/2023 | 8.603 |
| USD | 24.029.946 | CZK | 514.639.008 | HSBC | 13/7/2023 | 943.473 |
| USD | 603.786 | EUR | 569.462 | Barclays Bank | 14/6/2023 | (4.678) |
| USD | 1.200.106 | EUR | 1.098.695 | BNP Paribas | 14/6/2023 | 26.162 |
| USD | 1.411.071 | EUR | 1.301.189 | Morgan Stanley | 14/6/2023 | 20.764 |
| USD | 30.461.178 | EUR | 27.785.541 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 721.755 |
| USD | 31.854.398 | EUR | 28.780.000 | Citibank | 13/7/2023 | 1.050.585 |
| USD | 65.022.681 | EUR | 59.142.276 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | 1.721.514 |
| USD | 20.237.751 | EUR | 18.768.320 | JP Morgan | 13/7/2023 | 149.641 |
| USD | 258.215 | EUR | 240.000 | Natwest Markets | 13/7/2023 | 1.338 |
| USD | 10.745.827 | GBP | 8.490.000 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 226.954 |
| USD | 5.100.635 | GBP | 4.040.000 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | 95.188 |
| USD | 39.834.121 | HKD | 310.339.673 | Citibank | 15/9/2023 | 112.785 |
| USD | 22.641.689 | HUF | 7.815.981.007 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | 405.838 |
| USD | 24.947.199 | IDR | 374.485.587.758 | BNP Paribas | 30/6/2023 | (21.829) |
| USD | 9.055.471 | IDR | 136.583.665.047 | Deutsche Bank | 30/6/2023 | (51.319) |
| USD | 5.163.001 | IDR | 77.310.783.927 | Goldman Sachs | 30/6/2023 | 8.263 |
| USD | 9.053.670 | IDR | 136.583.665.046 | Standard Chartered Bank | 30/6/2023 | (53.119) |
| USD | 24.197.670 | IDR | 357.738.346.250 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | 351.273 |
| USD | 5.071.684 | JPY | 704.273.966 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 15.039 |
| USD | 964.811 | JPY | 129.080.864 | HSBC | 13/7/2023 | 38.018 |
| USD | 30.685.843 | JPY | 4.138.973.221 | JP Morgan | 13/7/2023 | 968.265 |
| USD | 5.011.344 | KRW | 6.597.935.000 | Citibank | 13/7/2023 | 20.772 |
| USD | 114.166 | KRW | 150.752.211 | JP Morgan | 13/7/2023 | 139 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------|---------|----------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 10.292.016 | KRW | 13.480.482.118 | Standard Chartered Bank | 13/7/2023 | 95.596 |
| USD | 7.148.000 | MXN | 127.670.428 | HSBC | 20/6/2023 | (47.970) |
| USD | 823.190 | MXN | 14.763.367 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (5.040) |
| USD | 115.368.832 | MXN | 2.074.632.119 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | (1.018.760) |
| USD | 26.785.306 | MXN | 490.128.242 | Barclays Bank | 31/8/2023 | (454.574) |
| USD | 19.813.453 | MXN | 371.076.264 | JP Morgan | 31/8/2023 | (809.869) |
| USD | 2.789.341 | NZD | 4.409.545 | UBS | 13/7/2023 | 145.389 |
| USD | 5.109.788 | PHP | 285.994.808 | HSBC | 13/7/2023 | 38.568 |
| USD | 19.033.750 | PLN | 79.236.924 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 424.630 |
| USD | 20.398.454 | SGD | 27.440.000 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 102.186 |
| USD | 3.016.165 | TRY | 62.461.700 | BNP Paribas | 20/6/2023 | 199.738 |
| USD | 1.120.536 | TRY | 23.643.300 | Citibank | 20/6/2023 | 54.448 |
| USD | 2.094.705 | TRY | 43.310.116 | UBS | 20/6/2023 | 141.831 |
| USD | 4.021.406 | ZAR | 78.070.500 | Bank of America Merrill Lynch | 13/7/2023 | 71.009 |
| USD | 10.511.235 | ZAR | 202.851.826 | Barclays Bank | 13/7/2023 | 246.857 |
| USD | 8.008.004 | ZAR | 155.099.500 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 159.911 |
| USD | 5.040.179 | ZAR | 95.065.000 | Citibank | 13/7/2023 | 229.854 |
| USD | 2.465.483 | ZAR | 48.902.900 | Deutsche Bank | 13/7/2023 | (9.022) |
| USD | 66.263.503 | ZAR | 1.235.955.485 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | 3.723.695 |
| USD | 2.523.846 | ZAR | 49.139.100 | HSBC | 13/7/2023 | 37.389 |
| USD | 7.939.785 | ZAR | 150.706.421 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 313.984 |
| USD | 5.176.480 | ZAR | 99.246.500 | UBS | 13/7/2023 | 154.570 |
| ZAR | 115.660.000 | USD | 5.972.695 | Barclays Bank | 13/7/2023 | (120.256) |
| ZAR | 584.046.300 | USD | 31.732.817 | Citibank | 13/7/2023 | (2.179.856) |
| ZAR | 769.435.502 | USD | 41.251.885 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | (2.318.160) |
| | | | | | | (6.651.040) |
| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| AUD | 882.283.315 | USD | 599.999.545 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (28.091.440) |
| USD | 9.634.661 | AUD | 14.632.567 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 149.632 |
| | | | | | | (27.941.808) |
| Auf CAD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CAD | 220.185.855 | USD | 165.186.006 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (3.472.998) |
| USD | 2.653.295 | CAD | 3.598.186 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 10.647 |
| | | | | | | (3.462.351) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 7.951 | USD | 8.979 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (255) |
| USD | 135 | CHF | 122 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 2 |
| | | | | | | (253) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 26.369.403 | USD | 29.184.034 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.006.912) |
| USD | 706.602 | EUR | 654.416 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 7.322 |
| | | | | | | (999.590) |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 330.181 | USD | 418.430 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (9.585) |
| USD | 5.438 | GBP | 4.384 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 10 |
| | | | | | | (9.575) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|--------|---------|----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SEK | 43.115 | USD | 4.034 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (65) |
| USD | 232 | SEK | 2.482 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 4 |
| | | | | | | (61) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 2.477.381.980) | | | | | | (39.064.678) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 73,03 |
| Energie | 10,52 |
| Grundstoffe | 4,03 |
| Finanzen | 3,45 |
| Versorger | 1,85 |
| Industrie | 1,74 |
| Kommunikation | 1,65 |
| Zyklische Konsumgüter | 0,92 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 0,51 |
| Diversifiziert | 0,28 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 0,20 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,18 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,82 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Kaimaninseln Fortsetzung | | | |
| ANLEIHEN | | | | USD 1.191.000 | Saudi Electricity Sukuk Programme Co RegS 5,684% 11/4/2053 | 1.182.365 | 1,41 |
| Argentinien | | | | USD 200.000 | Sharjah Sukuk Ltd RegS 3,764% 17/9/2024 | 196.317 | 0,23 |
| EUR 48.278 | Argentine Republic Government International Bond 0,50% 9/7/2029 | 11.392 | 0,01 | <hr/> | | | |
| EUR 802.870 | Argentine Republic Government International Bond 0,125% 9/7/2030 | 195.456 | 0,23 | China | | | |
| USD 1.000.000 | Argentine Republic Government International Bond 3,875% 9/1/2038 | 291.188 | 0,35 | USD 697.000 | China Development Bank RegS FRN 12/12/2023 | 697.915 | 0,83 |
| <hr/> | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 697.915 0,83 | | | |
| Bahrain | | | | Kolumbien | | | |
| USD 850.000 | Bahrain Government International Bond RegS 6,125% 1/8/2023 | 848.837 | 1,01 | USD 1.165.000 | Colombia Government International Bond 4,00% 26/2/2024 | 1.145.871 | 1,37 |
| USD 1.283.000 | Bahrain Government International Bond RegS 7,00% 26/1/2026 | 1.308.548 | 1,56 | USD 488.000 | Colombia Government International Bond 8,125% 21/5/2024 | 498.460 | 0,59 |
| USD 427.000 | Bahrain Government International Bond RegS 7,00% 12/10/2028 | 432.931 | 0,52 | USD 823.000 | Colombia Government International Bond 7,50% 2/2/2034 | 792.144 | 0,95 |
| USD 1.405.000 | Bahrain Government International Bond RegS 7,75% 18/4/2035 [^] | 1.389.194 | 1,66 | USD 451.000 | Ecopetrol SA 4,125% 16/1/2025 | 432.960 | 0,52 |
| <hr/> | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 2.869.435 3,43 | | | |
| Brasilien | | | | Tschechische Republik | | | |
| BRL 18.013.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,00% 1/1/2025 | 3.619.865 | 4,32 | CZK 2.190.000 | Czech Republic Government Bond 0,45% 25/10/2023 | 96.294 | 0,11 |
| USD 454.000 | Brazilian Government International Bond 8,875% 15/4/2024 | 468.385 | 0,56 | <hr/> | | | |
| USD 645.000 | Brazilian Government International Bond 4,25% 7/1/2025 | 637.047 | 0,76 | Dominikanische Republik | | | |
| USD 304.000 | Brazilian Government International Bond 8,75% 4/2/2025 | 322.371 | 0,39 | USD 113.334 | Dominican Republic International Bond RegS 5,875% 18/4/2024 | 112.172 | 0,13 |
| USD 772.000 | Brazilian Government International Bond 2,875% 6/6/2025 | 740.234 | 0,88 | USD 1.100.000 | Dominican Republic International Bond RegS 5,50% 27/1/2025 | 1.087.290 | 1,30 |
| USD 1.710.000 | Brazilian Government International Bond 6,00% 20/10/2033 | 1.680.930 | 2,01 | USD 449.000 | Dominican Republic International Bond RegS 6,875% 29/1/2026 | 454.454 | 0,54 |
| <hr/> | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 491.701 0,59 | | | |
| Bulgarien | | | | 2.145.617 2,56 | | | |
| EUR 575.000 | Bulgaria Government International Bond RegS 4,50% 27/1/2033 | 601.798 | 0,72 | Ägypten | | | |
| <hr/> | | | | EUR 3.500.000 | Egypt Government International Bond RegS 4,75% 16/4/2026 | 2.488.046 | 2,97 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | USD 2.018.000 | Egypt Government International Bond RegS 7,903% 21/2/2048 | 999.314 | 1,19 |
| Kanada | | | | <hr/> | | | |
| USD 815.000 | MEGlobal Canada ULC RegS 5,00% 18/5/2025 | 804.847 | 0,96 | Äthiopien | | | |
| <hr/> | | | | USD 855.000 | Ethiopia International Bond RegS 6,625% 11/12/2024 | 584.912 | 0,70 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 584.912 0,70 | | | |
| Kaimaninseln | | | | Gabun | | | |
| USD 1.937.000 | China Evergrande Group RegS 8,75% 28/6/2025 | 125.905 | 0,15 | USD 947.627 | Gabon Government International Bond RegS 6,375% 12/12/2024 [^] | 918.586 | 1,10 |
| USD 440.000 | Liberty Costa Rica Senior Secured Finance RegS 10,875% 15/1/2031 | 418.650 | 0,50 | USD 850.000 | Gabon Government International Bond RegS 6,95% 16/6/2025 | 812.955 | 0,97 |
| USD 735.000 | QNB Finance Ltd RegS 2,625% 12/5/2025 [^] | 701.808 | 0,84 | <hr/> | | | |
| <hr/> | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 1.731.541 2,07 | | | |
| | | | | Georgien | | | |
| | | | | USD 978.000 | Georgian Railway JSC RegS 4,00% 17/6/2028 [^] | 835.461 | 1,00 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 835.461 1,00 | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|-------------------|--|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Ghana | | | | Mexiko | | |
| USD 652.283 | Ghana Government International Bond RegS 8,125% 18/1/2026 | 278.322 | 0,33 | MXN 19.239.200 | Mexican Bonos 8,00% 7/11/2047 | 979.348 | 1,17 |
| USD 1.019.000 | Ghana Government International Bond RegS 6,375% 11/2/2027 | 414.392 | 0,50 | USD 205.000 | Mexico Government International Bond 3,90% 27/4/2025 | 202.216 | 0,24 |
| USD 400.000 | Ghana Government International Bond RegS 7,875% 26/3/2027 | 167.809 | 0,20 | USD 1.065.000 | Mexico Government International Bond 5,40% 9/2/2028 | 1.090.579 | 1,30 |
| | | 860.523 | 1,03 | USD 400.000 | Petroleos Mexicanos 4,625% 21/9/2023 | 395.473 | 0,47 |
| | Guatemala | | | USD 1.816.000 | Petroleos Mexicanos 6,875% 16/10/2025 | 1.751.695 | 2,09 |
| USD 637.000 | Guatemala Government Bond RegS 4,50% 3/5/2026 | 614.090 | 0,73 | USD 600.000 | Petroleos Mexicanos 6,95% 28/1/2060 | 358.140 | 0,43 |
| | | 614.090 | 0,73 | EUR 1.443.000 | Petroleos Mexicanos RegS 3,75% 21/2/2024 | 1.513.388 | 1,81 |
| | Ungarn | | | | | 6.290.839 | 7,51 |
| EUR 4.111.000 | Hungary Government International Bond RegS 5,00% 22/2/2027 | 4.405.947 | 5,26 | | Nigeria | | |
| USD 298.000 | Hungary Government International Bond RegS 5,50% 16/6/2034 | 285.722 | 0,34 | USD 424.000 | Nigeria Government International Bond RegS 7,625% 21/11/2025 [^] | 405.991 | 0,48 |
| | | 4.691.669 | 5,60 | USD 255.000 | Nigeria Government International Bond RegS 6,125% 28/9/2028 | 206.414 | 0,25 |
| | Indonesien | | | | | 612.405 | 0,73 |
| IDR 2.197.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029 | 161.441 | 0,19 | | Oman | | |
| IDR 2.240.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/4/2039 | 173.940 | 0,21 | USD 1.959.000 | Oman Government International Bond RegS 4,875% 1/2/2025 | 1.935.418 | 2,31 |
| | | 335.381 | 0,40 | USD 479.000 | Oman Government International Bond RegS 4,75% 15/6/2026 | 466.096 | 0,56 |
| | Jordanien | | | USD 897.000 | Oman Government International Bond RegS 6,75% 28/10/2027 | 931.113 | 1,11 |
| USD 485.000 | Jordan Government International Bond RegS 6,125% 29/1/2026 | 470.821 | 0,56 | | | 3.332.627 | 3,98 |
| USD 787.000 | Jordan Government International Bond RegS 7,75% 15/1/2028 | 794.327 | 0,95 | | Pakistan | | |
| USD 2.589.000 | Jordan Government International Bond RegS 7,50% 13/1/2029 | 2.559.576 | 3,06 | USD 815.000 | Pakistan Government International Bond RegS 8,25% 15/4/2024 | 435.155 | 0,52 |
| | | 3.824.724 | 4,57 | USD 427.000 | Pakistan Government International Bond RegS 8,25% 30/9/2025 | 183.978 | 0,22 |
| | Kenia | | | | | 619.133 | 0,74 |
| USD 930.000 | Republic of Kenya Government International Bond RegS 6,875% 24/6/2024 | 858.599 | 1,03 | | Panama | | |
| USD 480.000 | Republic of Kenya Government International Bond RegS 7,00% 22/5/2027 | 413.155 | 0,49 | USD 673.000 | Panama Government International Bond 4,00% 22/9/2024 | 661.298 | 0,79 |
| | | 1.271.754 | 1,52 | | | 661.298 | 0,79 |
| | Libanon | | | | Paraguay | | |
| USD 1.496.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,10% 4/10/2023 | 91.630 | 0,11 | USD 627.000 | Paraguay Government International Bond RegS 4,70% 27/3/2027 | 610.825 | 0,73 |
| USD 1.100.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,00% 27/1/2024 | 67.375 | 0,08 | | | 610.825 | 0,73 |
| USD 1.000.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,65% 22/4/2024 | 61.250 | 0,07 | | Philippinen | | |
| USD 2.000.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,20% 26/2/2025 | 122.300 | 0,15 | USD 225.000 | Philippine Government International Bond 4,625% 17/7/2028 [^] | 227.959 | 0,27 |
| USD 1.055.000 | Lebanon Government International Bond RegS 6,60% 27/11/2026 | 64.513 | 0,08 | | | 227.959 | 0,27 |
| | | 407.068 | 0,49 | | Polen | | |
| | | | | USD 200.000 | Republic of Poland Government International Bond 4,00% 22/1/2024 | 198.245 | 0,24 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Polen Fortsetzung | | | | Schweden | | |
| EUR 1.625.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 4,25% 14/2/2043 | 1.676.517 | 2,00 | EUR 152.058 | East Renewable AB RegS 13,50% 1/1/2025 | 24.354 | 0,03 |
| | | 1.874.762 | 2,24 | | | 24.354 | 0,03 |
| | Katar | | | | Türkei | | |
| USD 1.096.000 | Qatar Government International Bond RegS 3,375% 14/3/2024 | 1.080.056 | 1,29 | USD 844.000 | Turkey Government International Bond 9,125% 13/7/2030 | 808.130 | 0,97 |
| USD 1.754.000 | Qatar Government International Bond RegS 3,25% 2/6/2026 | 1.698.280 | 2,03 | USD 1.404.000 | Turkey Government International Bond 9,375% 19/1/2033 [^] | 1.349.911 | 1,61 |
| | | 2.778.336 | 3,32 | | | 2.158.041 | 2,58 |
| | Rumänien | | | | Ukraine | | |
| EUR 1.000.000 | Romanian Government International Bond RegS 5,00% 27/9/2026 | 1.072.547 | 1,28 | USD 742.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2024 | 166.763 | 0,20 |
| EUR 951.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,75% 14/4/2041 | 603.090 | 0,72 | USD 977.000 | Ukraine Government International Bond RegS 8,994% 1/2/2026 | 196.294 | 0,23 |
| | | 1.675.637 | 2,00 | USD 1.446.000 | Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2027 | 283.000 | 0,34 |
| | Russland | | | EUR 531.000 | Ukraine Government International Bond RegS 6,75% 20/6/2028 | 100.187 | 0,12 |
| USD 400.000 | Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,875% 16/9/2023 | 348.000 | 0,42 | USD 1.607.000 | Ukraine Government International Bond RegS FRN 1/8/2041 | 468.565 | 0,56 |
| | | 348.000 | 0,42 | | | 1.214.809 | 1,45 |
| | Saudi-Arabien | | | | Vereinigte Arabische Emirate | | |
| USD 2.054.000 | Saudi Government International Bond RegS 2,90% 22/10/2025 | 1.974.387 | 2,36 | USD 2.280.000 | Abu Dhabi Government International Bond RegS 2,125% 30/9/2024 | 2.191.479 | 2,62 |
| USD 1.600.000 | Saudi Government International Bond RegS 4,75% 18/1/2028 | 1.611.616 | 1,92 | USD 2.469.000 | Abu Dhabi Government International Bond RegS 2,50% 16/4/2025 | 2.371.802 | 2,83 |
| USD 874.000 | Saudi Government International Bond RegS 5,00% 18/1/2053 | 803.735 | 0,96 | | | 4.563.281 | 5,45 |
| | | 4.389.738 | 5,24 | | Vereinigte Staaten von Amerika | | |
| | Südafrika | | | USD 950.600 | United States Treasury Bill 24/11/2023 (Zero Coupon) | 926.504 | 1,11 |
| USD 800.000 | Eskom Holdings SOC Ltd RegS 7,125% 11/2/2025 | 766.948 | 0,92 | USD 4.282.900 | United States Treasury Note/ Bond 0,125% 15/10/2023 | 4.199.828 | 5,01 |
| ZAR 8.851.070 | Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035 | 351.606 | 0,42 | USD 97.700 | United States Treasury Note/ Bond 2,50% 30/4/2024 | 95.334 | 0,11 |
| USD 623.000 | Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 16/9/2025 | 615.452 | 0,73 | | | 5.221.666 | 6,23 |
| EUR 1.000.000 | Republic of South Africa Government International Bond 3,75% 24/7/2026 | 996.552 | 1,19 | | Venezuela | | |
| | | 2.730.558 | 3,26 | USD 471.500 | Petroleos de Venezuela SA RegS 8,50% 27/10/2023 | 175.634 | 0,21 |
| | Sri Lanka | | | USD 1.678.200 | Petroleos de Venezuela SA RegS 12,75% 17/2/2024 | 50.346 | 0,06 |
| USD 460.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 5,875% 25/7/2023 [^] | 178.124 | 0,21 | USD 700.000 | Petroleos de Venezuela SA RegS 6,00% 16/5/2024 | 23.450 | 0,03 |
| USD 566.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 6,85% 14/3/2024 | 207.181 | 0,25 | USD 1.466.217 | Petroleos de Venezuela SA RegS 9,75% 17/5/2035 | 43.986 | 0,05 |
| USD 419.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 6,35% 28/6/2024 | 153.461 | 0,18 | USD 602.900 | Venezuela Government International Bond RegS 12,75% 23/8/2023 | 41.299 | 0,05 |
| USD 1.130.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 6,125% 3/6/2025 | 441.418 | 0,53 | USD 985.800 | Venezuela Government International Bond RegS 7,75% 13/10/2023 | 67.527 | 0,08 |
| USD 1.670.000 | Sri Lanka Government International Bond RegS 6,85% 3/11/2025 | 640.645 | 0,76 | USD 1.473.500 | Venezuela Government International Bond RegS 9,00% 7/5/2024 | 100.935 | 0,12 |
| | | 1.620.829 | 1,93 | | | 503.177 | 0,60 |
| | | | | | Sambia | | |
| | | | | USD 950.000 | Zambia Government International Bond RegS 5,375% 20/9/2023 | 430.785 | 0,51 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|
| Sambia Fortsetzung | | | |
| USD 688.000 | Zambia Government International Bond RegS 8,50% 14/4/2024 | 339.915 | 0,41 |
| | | 770.700 | 0,92 |
| Gesamt Anleihen | | 82.660.786 | 98,69 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 82.660.786 | 98,69 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 82.660.786 | 98,69 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 1.098.155 | 1,31 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 83.758.941 | 100,00 |
| ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|---|----------------|---|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 9.249.500 | Fund receives default protection on Markit CDX.EM.39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (66.335) | 573.925 |
| CCCDs | USD 3.361.200 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Asia Ex-Japan Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (22.756) | 34.022 |
| CCIRS | MXN 30.856.200 | Fund receives Fixed 8,500% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Morgan Stanley | 24/1/2028 | (3.534) | (3.518) |
| CCIRS | USD 6.520.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 4,167% | Morgan Stanley | 19/4/2025 | 20.561 | 21.013 |
| CDS | USD 5.322.898 | Fund receives default protection on Korea International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (14.483) | (147.752) |
| CDS | USD 2.473.000 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (9.182) | 17.168 |
| CDS | USD 2.027.000 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (7.526) | 14.071 |
| CDS | USD 2.505.568 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Chile Government International Bond | Goldman Sachs | 20/6/2028 | 15.723 | 16.869 |
| CDS | USD 1.994.432 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Chile Government International Bond | Goldman Sachs | 20/6/2028 | 12.516 | 13.427 |
| CDS | USD 1.957.558 | Fund receives default protection on Korea International Bond and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (4.368) | (54.338) |
| CDS | USD 4.078.246 | Fund receives default protection on Korea International Bond and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (9.874) | (113.204) |
| CDS | USD 1.631.298 | Fund receives default protection on Korea International Bond and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (3.950) | (45.281) |
| CDS | USD 3.000.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond | Morgan Stanley | 20/6/2026 | (900.882) | (2.058.882) |
| IRS | BRL 16.377.903 | Fund receives Fixed 13,900% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Bank of America Merrill Lynch | 1/4/2024 | 33.502 | 33.502 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 47.731.863) | | | | | (960.588) | (1.698.978) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps
CDS: Credit Default Swaps
IRS: Zinsraten-Swaps

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (16) | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 2.318.469 | (29.940) |
| 1 | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 147.029 | (1.217) |
| (8) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 8.481.433 | (121.143) |
| 10 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 1.194.202 | 17.083 |
| 4 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 457.688 | 687 |
| (69) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 14.208.609 | 6.527 |
| 13 | USD | US Ultra Bond Futures September 2023 | September 2023 | 1.771.250 | 16.555 |
| Gesamt | | | | | (111.448) |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Netto(-verlust) USD | Marktwert USD |
|--|-----------|-----------------------|-------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 7.000.000 | Put | OTC EUR/CHF | UBS | EUR 0,95 | 31/05/2023 | (60.411) | — |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 0) | | | | | | (60.411) | — |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|---------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 645.104 | USD | 420.985 | JP Morgan | 13/7/2023 | (2.374) |
| AUD | 279.183 | USD | 189.078 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (7.915) |
| BRL | 13.302.787 | USD | 2.672.826 | BNP Paribas | 2/6/2023 | (51.664) |
| BRL | 1.605.747 | USD | 314.725 | Goldman Sachs | 2/6/2023 | 1.669 |
| BRL | 1.605.747 | USD | 320.850 | BNP Paribas | 5/7/2023 | (6.133) |
| CAD | 1.105.784 | USD | 826.333 | JP Morgan | 13/7/2023 | (13.628) |
| CHF | 2.532.804 | USD | 2.857.548 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | (69.278) |
| CLP | 95.626.243 | USD | 119.495 | Bank of America | 13/7/2023 | (2.137) |
| CLP | 332.262.902 | USD | 417.201 | Merrill Lynch | 13/7/2023 | (9.428) |
| CLP | 177.585.000 | USD | 222.242 | BNP Paribas | 13/7/2023 | (4.299) |
| COP | 1.458.544.935 | USD | 315.670 | HSBC | 13/7/2023 | (4.299) |
| EUR | 756.294 | USD | 830.994 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 12.826 |
| EUR | 2.272.110 | USD | 2.498.021 | Deutsche Bank | 13/7/2023 | (21.517) |
| EUR | 90.000 | USD | 97.265 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | (66.136) |
| GBP | 502.132 | USD | 625.282 | Standard Chartered Bank | 13/7/2023 | (936) |
| GBP | 496.252 | USD | 620.102 | BNP Paribas | 13/7/2023 | (3.155) |
| GBP | 480.372 | USD | 606.169 | Citibank | 13/7/2023 | (5.259) |
| GBP | 670.221 | USD | 838.970 | JP Morgan | 13/7/2023 | (11.001) |
| HKD | 12.865.299 | USD | 1.651.387 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (8.585) |
| HKD | 12.983.501 | USD | 1.665.555 | Goldman Sachs | 15/9/2023 | (4.718) |
| HUF | 207.540.975 | USD | 601.214 | HSBC | 15/9/2023 | (3.757) |
| INR | 67.792.653 | USD | 823.226 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | (10.776) |
| JPY | 115.191.213 | USD | 860.993 | HSBC | 13/7/2023 | (4.626) |
| JPY | 3.040.000 | USD | 21.875 | HSBC | 13/7/2023 | (33.927) |
| JPY | 2.400.000 | USD | 17.457 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (48) |
| KRW | 844.330.660 | USD | 639.194 | Standard Chartered Bank | 13/7/2023 | (225) |
| KRW | 1.105.753.449 | USD | 834.871 | JP Morgan | 13/7/2023 | (556) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|------------|---------|----------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| MXN | 69.125.100 | USD | 3.842.886 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | 35.057 |
| NZD | 657.853 | USD | 413.902 | JP Morgan | 13/7/2023 | (19.455) |
| NZD | 657.365 | USD | 418.068 | Natwest Markets | 13/7/2023 | (23.914) |
| NZD | 909.864 | USD | 575.552 | UBS | 13/7/2023 | (30.000) |
| PLN | 5.953.839 | USD | 1.427.187 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | (28.903) |
| USD | 650.154 | AUD | 959.985 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 27.216 |
| USD | 743.636 | BRL | 3.707.353 | BNP Paribas | 2/6/2023 | 13.144 |
| USD | 2.195.419 | BRL | 11.201.181 | Goldman Sachs | 2/6/2023 | (11.644) |
| USD | 2.658.080 | BRL | 13.302.787 | BNP Paribas | 5/7/2023 | 50.810 |
| USD | 2.948.180 | CAD | 3.945.201 | JP Morgan | 13/7/2023 | 48.621 |
| USD | 208.430 | CHF | 184.743 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | 5.053 |
| USD | 748.543 | CLP | 605.474.145 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 5.469 |
| USD | 557.798 | CNY | 3.841.762 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | 15.908 |
| USD | 95.779 | CZK | 2.051.251 | HSBC | 13/7/2023 | 3.760 |
| USD | 835.617 | EUR | 768.338 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 13.250 |
| USD | 75.964 | EUR | 70.000 | Deutsche Bank | 13/7/2023 | 1.041 |
| USD | 18.514.264 | EUR | 16.839.904 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | 490.176 |
| USD | 1.677.485 | EUR | 1.555.686 | JP Morgan | 13/7/2023 | 12.403 |
| USD | 10.759 | EUR | 10.000 | Natwest Markets | 13/7/2023 | 56 |
| USD | 3.317.862 | HKD | 25.848.800 | Citibank | 15/9/2023 | 9.394 |
| USD | 439.129 | HUF | 151.588.643 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | 7.871 |
| USD | 769.066 | IDR | 11.369.872.709 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | 11.164 |
| USD | 422.549 | JPY | 58.676.858 | BNP Paribas | 13/7/2023 | 1.253 |
| USD | 795.893 | JPY | 106.481.522 | HSBC | 13/7/2023 | 31.362 |
| USD | 841.187 | JPY | 115.329.040 | JP Morgan | 13/7/2023 | 13.131 |
| USD | 645.916 | KRW | 853.209.830 | JP Morgan | 13/7/2023 | 562 |
| USD | 4.464.720 | MXN | 80.310.532 | State Street Bank & Trust Company | 13/7/2023 | (40.728) |
| USD | 809.928 | NZD | 1.280.379 | UBS | 13/7/2023 | 42.216 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 361.593 | PHP | 20.238.337 | HSBC | 13/7/2023 | 2.729 |
| USD | 1.493.267 | PLN | 6.215.945 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 33.426 |
| USD | 183.858 | TWD | 5.614.838 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 700 |
| USD | 804.790 | ZAR | 15.554.514 | Barclays Bank | 13/7/2023 | 17.726 |
| USD | 1.207.733 | ZAR | 22.526.797 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | 67.869 |
| USD | 412.211 | ZAR | 7.777.257 | Morgan Stanley | 13/7/2023 | 18.679 |
| USD | 424.647 | ZAR | 8.141.582 | UBS | 13/7/2023 | 12.680 |
| ZAR | 58.776.815 | USD | 3.151.213 | Goldman Sachs | 13/7/2023 | (177.084) |
| | | | | | | 334.918 |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 22.096.092 | USD | 24.454.244 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (843.384) |
| USD | 147.904 | EUR | 136.684 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1.849 |
| | | | | | | (841.535) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 103.334.030) | | | | | | (506.617) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 86,38 |
| Energie | 5,70 |
| Versorger | 2,33 |
| Finanzen | 1,82 |
| Industrie | 1,00 |
| Grundstoffe | 0,96 |
| Kommunikation | 0,50 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,69 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,31 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---------------------------------------|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIE | | | | | | | |
| Belgien | | | | Japan | | | |
| 454.749 | Azelis Group NV | 10.413.752 | 0,76 | EUR 20.500.000 | MUFG Bank Ltd 2/8/2023 (Zero Coupon) | 20.377.149 | 1,49 |
| | | 10.413.752 | 0,76 | EUR 25.500.000 | MUFG Bank Ltd 10/8/2023 (Zero Coupon) | 25.326.889 | 1,86 |
| Dänemark | | | | Südkorea | | | |
| 148.776 | DSV A/S | 26.977.282 | 1,97 | EUR 20.000.000 | KEB Hana Bank 14/8/2023 (Zero Coupon) | 19.857.408 | 1,45 |
| 274.565 | Novo Nordisk A/S 'B' | 41.207.855 | 3,02 | | | 19.857.408 | 1,45 |
| 374.878 | Royal Unibrew A/S^ | 30.119.812 | 2,20 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 597.285 | Tryg A/S | 12.795.261 | 0,94 | EUR 19.000.000 | Citibank NA 8/8/2023 (Zero Coupon) | 18.877.212 | 1,38 |
| | | 111.100.210 | 8,13 | | | 18.877.212 | 1,38 |
| Finnland | | | | Gesamt Einlagenzertifikate | | | |
| 1.085.824 | Nordea Bank Abp | 10.072.395 | 0,74 | | | 243.456.859 | 17,82 |
| | | 10.072.395 | 0,74 | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| Deutschland | | | | Österreich | | | |
| 192.649 | Beiersdorf AG | 23.127.513 | 1,69 | EUR 89.500.000 | Erste Group Bank AG RegS 7/6/2023 (Zero Coupon) | 89.452.996 | 6,55 |
| 100.913 | MTU Aero Engines AG | 21.938.486 | 1,61 | | | 89.452.996 | 6,55 |
| 221.654 | Symrise AG | 22.387.054 | 1,64 | Frankreich | | | |
| | | 67.453.053 | 4,94 | EUR 15.000.000 | Antalis SA 12/6/2023 (Zero Coupon) | 14.985.239 | 1,10 |
| Irland | | | | EUR 55.000.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA 6/11/2023 (Zero Coupon) | 54.133.990 | 3,96 |
| 115.991 | Linde Plc (traded in Germany) | 38.474.215 | 2,82 | EUR 10.000.000 | BPCE SA 15/8/2023 (Zero Coupon) | 9.933.380 | 0,73 |
| | | 38.474.215 | 2,82 | EUR 14.500.000 | Satellite SASU 22/8/2023 (Zero Coupon) | 14.386.401 | 1,05 |
| Niederlande | | | | EUR 21.000.000 | Svenska Handelsbanken AB 3/7/2023 (Zero Coupon) | 20.949.458 | 1,53 |
| 7.229 | Adyen NV^ | 11.233.866 | 0,82 | | | 114.388.468 | 8,37 |
| 44.994 | ASM International NV | 18.249.566 | 1,34 | Irland | | | |
| 32.666 | ASML Holding NV | 22.111.616 | 1,62 | EUR 88.000.000 | Weinberg Capital DAC 9/6/2023 (Zero Coupon) | 87.936.622 | 6,44 |
| 489.442 | ASR Nederland NV | 19.538.525 | 1,43 | | | 87.936.622 | 6,44 |
| 194.822 | IMCD NV^ | 27.499.125 | 2,01 | Luxemburg | | | |
| | | 98.632.698 | 7,22 | EUR 7.500.000 | Albion Capital Corp SA 26/6/2023 (Zero Coupon) | 7.482.863 | 0,55 |
| Schweiz | | | | | | 7.482.863 | 0,55 |
| 67.569 | Lonza Group AG Reg | 39.509.013 | 2,89 | Großbritannien | | | |
| 82.705 | Sika AG Reg^ | 21.226.173 | 1,55 | EUR 40.000.000 | Barclays Bank Plc 25/7/2023 (Zero Coupon) | 39.793.610 | 2,91 |
| | | 60.735.186 | 4,44 | EUR 20.000.000 | Barclays Bank Plc 5/2/2024 (Zero Coupon) | 19.514.341 | 1,43 |
| Großbritannien | | | | EUR 100.000.000 | Ntt Capital UK Ltd 23/6/2023 (Zero Coupon) | 99.793.043 | 7,30 |
| 223.949 | London Stock Exchange Group Plc | 22.188.499 | 1,62 | | | 159.100.994 | 11,64 |
| 1.056.544 | RELX Plc^ | 31.115.221 | 2,28 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 548.356 | Shell Plc^ | 14.408.054 | 1,06 | EUR 52.000.000 | Collateralized Commercial Paper III Co LLC 11/9/2023 (Zero Coupon) | 51.487.648 | 3,77 |
| | | 67.711.774 | 4,96 | EUR 28.000.000 | Collateralized Commercial Paper III Co LLC RegS 18/9/2023 (Zero Coupon) | 27.703.531 | 2,03 |
| Gesamt Stammaktien | | | | | | 79.191.179 | 5,80 |
| | | 464.593.283 | 34,01 | Gesamt kurzfristige Titel | | | |
| EINLAGENZERTIFIKATE | | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| Belgien | | | | EUR 50.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 17/8/2023 (Zero Coupon) | 49.636.368 | 3,63 |
| | | 49.636.368 | 3,63 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| Kanada | | | | EUR 20.000.000 | The Toronto Dominion Bank 3,452% 14/7/2023 | 20.000.000 | 1,47 |
| EUR 50.000.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 2/6/2023 | 50.000.000 | 3,66 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| | | 70.000.000 | 5,13 | | | 1.245.603.264 | 91,18 |
| Frankreich | | | | EUR 40.000.000 | Credit Agricole SA 1/11/2023 (Zero Coupon) | 39.381.833 | 2,88 |
| | | 39.381.833 | 2,88 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 958.968 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 95.441.928 | 6,98 |
| | | 95.441.928 | 6,98 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 95.441.928 | 6,98 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 1.341.045.192 | 98,16 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 25.067.225 | 1,84 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 1.366.112.417 | 100,00 |

[^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

BlackRock European Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------------|--|-------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (163.761) | Henkel AG & Co KGaA (Pref) | JP Morgan | (68.780) |
| Belgien | | | | (100) | Nemetschek SE | Bank of America Merrill Lynch | (490) |
| (213.648) | Anheuser-Busch InBev SA | JP Morgan | 1.670.965 | (1.201.199) | thyssenkrupp AG | Citibank | 516.515 |
| (349.432) | Etablissements Franz Colruyt NV | Citibank | (293.523) | (90.261) | Volkswagen AG (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 173.301 |
| (1.228.849) | Proximus SADP | Citibank | 88.477 | (318.859) | Vonovia SE | Barclays Bank | 207.258 |
| (300.514) | Umicore SA | Bank of America Merrill Lynch | 935.362 | (212.511) | Zalando SE | BNP Paribas | 986.051 |
| | | | 2.401.281 | | | | 2.817.811 |
| Dänemark | | | | Irland | | | |
| (388.192) | Ambu A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 234.547 | 2.242.289 | AIB Group Plc | BNP Paribas | (273.559) |
| (415.210) | ISS A/S | Barclays Bank | 381.882 | | | | (273.559) |
| (168.029) | Netcompany Group A/S | Barclays Bank | (496.338) | Niederlande | | | |
| (203.975) | Novozymes A/S 'B' | Barclays Bank | 618.950 | (429.430) | Just Eat Takeaway.com NV | JP Morgan | 892.620 |
| (92.944) | Orsted AS | Bank of America Merrill Lynch | 601.505 | (538.141) | Koninklijke Philips NV | Barclays Bank | 543.522 |
| | | | 1.340.546 | (178.086) | Randstad NV | Barclays Bank | 386.447 |
| Finnland | | | | 88.863 | Shell Plc | BNP Paribas | (152.400) |
| (492.537) | Kesko Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 504.850 | (362.308) | Universal Music Group NV | JP Morgan | 202.546 |
| (205.351) | Kone Oyj 'B' | BNP Paribas | 689.979 | | | | 1.872.735 |
| (2.361.121) | Nokia Oyj | Barclays Bank | (7.083) | Norwegen | | | |
| | | | 1.187.746 | (606.833) | Nordic Semiconductor ASA | Barclays Bank | (38.204) |
| Frankreich | | | | (1.368.648) | Scatec ASA | Citibank | (120.631) |
| (399.730) | Alstom SA | Bank of America Merrill Lynch | (15.989) | | | | (158.835) |
| 131.816 | Alten SA | Bank of America Merrill Lynch | (883.167) | Polen | | | |
| (377.127) | Bouygues SA | Citibank | 184.792 | (861.468) | Allegro.eu SA | Citibank | 541.980 |
| (485.715) | Carrefour SA | Barclays Bank | 310.858 | (360.477) | CD Projekt SA | JP Morgan | (731.526) |
| (462.159) | Casino Guichard Perrachon SA | Bank of America Merrill Lynch | 519.929 | | | | (189.546) |
| (64.583) | Casino Guichard Perrachon SA | Citibank | 76.208 | Portugal | | | |
| (171.535) | Eurofins Scientific SE | JP Morgan | 337.127 | (1.036.709) | Galp Energia SGPS SA | BNP Paribas | 784.789 |
| (241.986) | Eutelsat Communications SA | Barclays Bank | 55.657 | (494.949) | Jeronimo Martins SGPS SA | Barclays Bank | 19.798 |
| (108.463) | Eutelsat Communications SA | Citibank | 24.946 | | | | 804.587 |
| (941.201) | Eutelsat Communications SA | JP Morgan | 423.540 | Spanien | | | |
| 8.032 | Hermes International | JP Morgan | (781.514) | (336.176) | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | Barclays Bank | 84.044 |
| 205.722 | Legrand SA | Barclays Bank | 172.806 | (5.982.741) | Mapfre SA | JP Morgan | 29.914 |
| 55.474 | L'Oreal SA | Citibank | (1.062.327) | (664.678) | Repsol SA | Bank of America Merrill Lynch | 445.839 |
| 35.050 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | JP Morgan | (2.446.490) | (3.082.362) | Telefonica SA | Citibank | (30.824) |
| 128.736 | Pernod Ricard SA | JP Morgan | (2.008.282) | | | | 528.973 |
| 64.797 | Schneider Electric SE | Bank of America Merrill Lynch | 177.775 | Schweden | | | |
| (72.087) | SOITEC | JP Morgan | (599.048) | 993.534 | Atlas Copco AB 'B' | JP Morgan | 684.844 |
| (411.588) | Ubisoft Entertainment SA | JP Morgan | 160.519 | (872.444) | Elekta AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 625.432 |
| (232.026) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 424.608 | (660.437) | Embracer Group AB | Barclays Bank | 917.024 |
| 298.198 | Vinci SA | Barclays Bank | (1.013.873) | (1.000.000) | Embracer Group AB | JP Morgan | 2.349.655 |
| | | | (5.941.925) | (759.795) | H & M Hennes & Mauritz AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 468.736 |
| Deutschland | | | | (889.199) | Hexatronic Group AB | Barclays Bank | 147.294 |
| (1.470.906) | Auto1 Group SE | Bank of America Merrill Lynch | (102.963) | (158.721) | Intrum AB | Barclays Bank | 88.072 |
| (105.522) | BASF SE | JP Morgan | 230.038 | (643.778) | Intrum AB | Citibank | 357.224 |
| (137.903) | Brenntag SE | Barclays Bank | 237.193 | (732.092) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | BNP Paribas | 201.474 |
| (53.253) | Deutsche Boerse AG | Citibank | 306.205 | (2.822.591) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | JP Morgan | 1.186.825 |
| (256.154) | Deutsche Post AG Reg | JP Morgan | (110.146) | (1.211.069) | Securitas AB 'B' | Barclays Bank | 463.309 |
| (30.247) | Evotec SE | JP Morgan | (112.216) | (604.267) | SKF AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 489.413 |
| (200.666) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Barclays Bank | 555.845 | (424.693) | Viaplay Group AB | BNP Paribas | 989.085 |
| | | | | (563.645) | Volvo Car AB 'B' | Barclays Bank | 49.051 |
| | | | | (341.698) | Volvo Car AB 'B' | BNP Paribas | 5.594 |
| | | | | (323.998) | Volvo Car AB 'B' | Citibank | 28.196 |
| | | | | (1.219.582) | Volvo Car AB 'B' | JP Morgan | 155.522 |
| | | | | | | | 9.206.750 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Schweiz | | | |
| (283.405) | ABB Ltd Reg | BNP Paribas | (174.496) |
| (8.910) | EMS-Chemie Holding AG Reg | Barclays Bank | 41.145 |
| (41.259) | Kuehne + Nagel International AG Reg | JP Morgan | 584.284 |
| (13.771) | Sonova Holding AG Reg | Barclays Bank | 272.740 |
| (33.043) | Swatch Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 888.397 |
| | | | <u>1.612.070</u> |
| Großbritannien | | | |
| (3.939.403) | abrdn Plc | Citibank | 557.194 |
| (586.111) | Antofagasta Plc | JP Morgan | 636.935 |
| (405.682) | Associated British Foods Plc | Barclays Bank | 303.362 |
| 172.033 | AstraZeneca Plc | JP Morgan | (474.684) |
| (882.541) | Carnival Plc | Barclays Bank | (128.920) |
| 1.098.845 | Compass Group Plc | Citibank | (229.311) |
| (52.069) | Ferguson Plc | Barclays Bank | 132.806 |
| (1.091.989) | Glencore Plc | JP Morgan | 421.578 |
| (525.604) | Hargreaves Lansdown Plc | Barclays Bank | 74.342 |
| 9.522.261 | JD Sports Fashion Plc | Barclays Bank | (888.693) |
| (416.654) | Johnson Matthey Plc | JP Morgan | 875.687 |
| (1.575.881) | Kingfisher Plc | BNP Paribas | 316.072 |
| (4.483.780) | Marks & Spencer Group Plc | Barclays Bank | (852.717) |
| 118.357 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Citibank | (432.236) |
| (213.016) | TUI AG | Bank of America Merrill Lynch | 33.340 |
| (56.683) | TUI AG | JP Morgan | 32.792 |
| (10.897.775) | Vodafone Group Plc | Barclays Bank | 523.063 |
| | | | <u>900.610</u> |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – EUR 873.583.413) | | | 16.109.244 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 94.873.071 | CHF | 92.716.701 | HSBC | 16/6/2023 | (346.223) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 19.574.276 | EUR | 19.975.460 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 125.988 |
| EUR | 29.792 | CHF | 28.892 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 123 |
| | | | | | | 126.111 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 425.584 | GBP | 370.425 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (3.665) |
| GBP | 7.914.605 | EUR | 9.063.323 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 108.137 |
| | | | | | | 104.472 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 477.178 | USD | 519.167 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (8.680) |
| USD | 11.961.697 | EUR | 10.808.151 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 386.131 |
| | | | | | | 377.451 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 136.631.264) | | | | | | 261.811 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 61,90 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 12,90 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 6,98 |
| Industrie | 5,13 |
| Grundstoffe | 4,46 |
| Technologie | 2,96 |
| Zyklische Konsumgüter | 2,77 |
| Energie | 1,06 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,16 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,84 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Opportunities Extension Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---------------------------------------|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Schweiz | | | |
| STAMMAKTIE | | | | 42.063 | Lonza Group AG Reg [^] | 24.595.119 | 4,06 |
| Belgien | | | | 35.733 | Roche Holding AG | 10.527.589 | 1,74 |
| 256.617 | Azelis Group NV | 5.876.529 | 0,97 | 81.353 | SKAN Group AG | 6.620.229 | 1,09 |
| 104.270 | Kinepolis Group NV [^] | 4.368.913 | 0,72 | 88.828 | Straumann Holding AG Reg [^] | 12.187.301 | 2,01 |
| 1.575 | Lotus Bakeries NV | 9.198.000 | 1,52 | 21.894 | Tecan Group AG Reg [^] | 7.895.018 | 1,31 |
| | | 19.443.442 | 3,21 | | | 61.825.256 | 10,21 |
| Dänemark | | | | Großbritannien | | | |
| 121.899 | DSV A/S | 22.103.725 | 3,65 | 90.777 | AstraZeneca Plc | 12.288.130 | 2,03 |
| 23.879 | Genmab A/S | 8.759.263 | 1,45 | 866.214 | BP Plc | 4.567.823 | 0,75 |
| 195.336 | Novo Nordisk A/S 'B' | 29.316.838 | 4,84 | 416.189 | Computacenter Plc | 11.203.887 | 1,85 |
| 168.833 | Royal Unibrew A/S [^] | 13.564.995 | 2,24 | 640.199 | RELX Plc | 18.853.861 | 3,11 |
| 656.364 | Tryg A/S [^] | 14.060.873 | 2,32 | | | 46.913.701 | 7,74 |
| | | 87.805.694 | 14,50 | Gesamt Stammaktien | | | |
| Finnland | | | | EINLAGENZERTIFIKATE | | | |
| 814.796 | Nordea Bank Abp | 7.558.267 | 1,25 | Belgien | | | |
| 490.926 | UPM-Kymmene Oyj [^] | 13.839.204 | 2,28 | EUR 1.500.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 17/8/2023 (Zero Coupon) | 1.489.091 | 0,24 |
| | | 21.397.471 | 3,53 | | | 1.489.091 | 0,24 |
| Frankreich | | | | Gesamt Einlagenzertifikate | | | |
| 91.547 | Alten SA [^] | 13.796.133 | 2,28 | 1.489.091 0,24 | | | |
| 7.767 | Hermes International | 14.852.058 | 2,45 | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| 9.749 | Sartorius Stedim Biotech | 2.390.455 | 0,39 | Österreich | | | |
| 95.524 | Schneider Electric SE | 15.566.591 | 2,57 | EUR 4.000.000 | Erste Group Bank AG RegS 7/6/2023 (Zero Coupon) | 3.997.899 | 0,66 |
| 42.629 | SEB SA | 3.734.300 | 0,62 | | | 3.997.899 | 0,66 |
| 100.567 | Vinci SA | 10.750.612 | 1,77 | Irland | | | |
| | | 61.090.149 | 10,08 | EUR 2.000.000 | Matchpoint Finance Plc 3/8/2023 (Zero Coupon) | 1.988.031 | 0,33 |
| Deutschland | | | | Gesamt kurzfristige Titel | | | |
| 215.506 | AIXTRON SE | 6.260.449 | 1,04 | 5.985.930 0,99 | | | |
| 57.801 | Amadeus Fire AG | 6.982.361 | 1,15 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| 86.682 | Beiersdorf AG | 10.406.174 | 1,72 | 562.269.901 92,82 | | | |
| 685.807 | Commerzbank AG | 6.546.714 | 1,08 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| 56.589 | MTU Aero Engines AG | 12.302.449 | 2,03 | Irland | | | |
| 144.306 | RWE AG | 5.687.099 | 0,94 | 388.364 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 38.652.218 | 6,38 |
| 84.047 | Symrise AG | 8.488.747 | 1,40 | | | 38.652.218 | 6,38 |
| 60.094 | Wacker Chemie AG [^] | 7.469.684 | 1,23 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | | 64.143.677 | 10,59 | 38.652.218 6,38 | | | |
| Irland | | | | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| 3.022.140 | AIB Group Plc | 11.562.708 | 1,91 | 600.922.119 99,20 | | | |
| 71.188 | Linde Plc (traded in Germany) | 23.613.059 | 3,90 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| | | 35.175.767 | 5,81 | 4.828.260 0,80 | | | |
| Italien | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | |
| 243.248 | Intercos SpA | 3.823.858 | 0,63 | 605.750.379 100,00 | | | |
| 566.439 | UniCredit SpA | 10.282.001 | 1,70 | | | | |
| | | 14.105.859 | 2,33 | | | | |
| Niederlande | | | | [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |
| 40.101 | ASM International NV [^] | 16.264.966 | 2,69 | ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |
| 22.373 | ASML Holding NV | 15.144.284 | 2,50 | | | | |
| 304.733 | ASR Nederland NV [^] | 12.164.941 | 2,01 | | | | |
| 75.376 | BE Semiconductor Industries NV | 7.782.572 | 1,29 | | | | |
| 1.203.851 | Davide Campari-Milano NV [^] | 14.741.155 | 2,43 | | | | |
| 1.034.102 | Fugro NV [^] | 13.960.377 | 2,30 | | | | |
| 90.201 | IMCD NV [^] | 12.731.871 | 2,10 | | | | |
| | | 92.790.166 | 15,32 | | | | |
| Schweden | | | | | | | |
| 544.446 | AAK AB | 9.813.760 | 1,62 | | | | |
| 504.439 | AddTech AB 'B' [^] | 9.814.124 | 1,62 | | | | |
| 1.766.153 | Alleima AB | 6.732.283 | 1,11 | | | | |
| 520.695 | Assa Abloy AB 'B' | 10.897.575 | 1,80 | | | | |
| 403.383 | Beijer Ref AB [^] | 5.710.500 | 0,94 | | | | |
| 301.112 | Hemnet Group AB | 4.719.323 | 0,78 | | | | |
| 633.564 | SwedenCare AB | 2.416.133 | 0,40 | | | | |
| | | 50.103.698 | 8,27 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Opportunities Extension Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|---|-------------------------------|---|--------------------------------|--|-------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (26.661) | Henkel AG & Co KGaA (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 70.385 |
| Österreich | | | | (242.506) | thyssenkrupp AG | Citibank | 104.278 |
| (78.235) | AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG | Citibank | (90.753) | (9.680) | Volkswagen AG | Bank of America Merrill Lynch | 34.724 |
| | | | (90.753) | (44.552) | Zalando SE | JP Morgan | 243.990 |
| | | | | | | | 919.062 |
| Belgien | | | | Italien | | | |
| (35.315) | Anheuser-Busch InBev SA | Barclays Bank | 149.383 | (58.475) | Banca Generali SpA | BNP Paribas | 86.543 |
| (63.607) | Etablissements Franz Colruyt NV | Bank of America Merrill Lynch | (17.174) | | | | 86.543 |
| (201.748) | Proximus SADP | Bank of America Merrill Lynch | 71.015 | Niederlande | | | |
| (40.038) | Umicore SA | JP Morgan | 137.692 | (39.820) | Basic-Fit NV | Barclays Bank | 83.622 |
| | | | 340.916 | (105.576) | Just Eat Takeaway.com NV | Barclays Bank | 166.967 |
| Dänemark | | | | (94.890) | Koninklijke Philips NV | BNP Paribas | 51.698 |
| (66.497) | Ambu A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 40.178 | (912.517) | PostNL NV | JP Morgan | 122.323 |
| (72.477) | ISS A/S | JP Morgan | 86.609 | (28.769) | Randstad NV | Barclays Bank | 62.429 |
| (9.579) | Netcompany Group A/S | Barclays Bank | (28.295) | (58.162) | Universal Music Group NV | JP Morgan | 33.443 |
| (37.959) | Netcompany Group A/S | Citibank | (112.127) | | | | 520.482 |
| (36.650) | Novozymes A/S 'B' | Barclays Bank | 111.212 | Norwegen | | | |
| | | | 97.577 | (187.171) | Crayon Group Holding ASA | JP Morgan | (531.049) |
| Finnland | | | | (158.382) | Nordic Semiconductor ASA | Barclays Bank | (9.971) |
| (87.879) | Kesko Oyj 'B' | BNP Paribas | 90.076 | (306.020) | Scatec ASA | Citibank | (26.972) |
| (493.813) | Nokia Oyj | Barclays Bank | (1.481) | | | | (567.992) |
| (24.885) | QT Group Oyj | Barclays Bank | 22.894 | Polen | | | |
| | | | 111.489 | (151.211) | Allegro.eu SA | Citibank | 95.132 |
| Frankreich | | | | (53.901) | CD Projekt SA | Bank of America Merrill Lynch | (67.398) |
| 996.728 | ALD SA | Bank of America Merrill Lynch | (966.826) | | | | 27.734 |
| (44.431) | Alstom SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.777) | Spanien | | | |
| (122.698) | Bonduelle SCA | Citibank | (34.355) | (68.125) | ACS Actividades de Construcción y Servicios SA | Barclays Bank | 17.031 |
| (76.373) | Bouygues SA | Citibank | 37.423 | 710.911 | Fluidra SA | Barclays Bank | (35.545) |
| (29.645) | Casino Guichard Perrachon SA | Bank of America Merrill Lynch | 33.351 | (1.298.666) | Mapfre SA | JP Morgan | 6.493 |
| (70.386) | Casino Guichard Perrachon SA | JP Morgan | 130.918 | (339.557) | Telefonica SA | Bank of America Merrill Lynch | (11.545) |
| (24.444) | Eurofins Scientific SE | Bank of America Merrill Lynch | (47.421) | | | | (23.566) |
| (172.257) | Eutelsat Communications SA | Barclays Bank | 39.619 | Schweden | | | |
| 19.425 | L'Oreal SA | Citibank | (371.989) | 683.685 | Atlas Copco AB 'A' | Citibank | 220.905 |
| 24.717 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | Citibank | (1.569.530) | (190.180) | Elekta AB 'B' | JP Morgan | 135.352 |
| 49.031 | Pernod Ricard SA | JP Morgan | (764.884) | (466.272) | Embracer Group AB | Barclays Bank | 647.424 |
| (13.428) | SOITEC | Bank of America Merrill Lynch | (100.532) | (123.216) | H & M Hennes & Mauritz AB 'B' | Barclays Bank | 99.796 |
| (71.609) | Ubisoft Entertainment SA | JP Morgan | 27.928 | (214.110) | Hexatron Group AB | BNP Paribas | 76.135 |
| (41.615) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 76.155 | (342.034) | Instalco AB | Bank of America Merrill Lynch | 20.629 |
| | | | (3.511.920) | (52.045) | Intrum AB | Barclays Bank | 28.879 |
| Deutschland | | | | (139.471) | Intrum AB | Citibank | 77.391 |
| (304.268) | Auto1 Group SE | Bank of America Merrill Lynch | (21.299) | (338.804) | Peab AB 'B' | Citibank | 82.906 |
| (268.815) | Bauer AG | JP Morgan | 48.387 | (386.815) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | Barclays Bank | 78.956 |
| (19.779) | Brenntag SE | Citibank | 34.020 | (585.361) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | BNP Paribas | 161.093 |
| (10.865) | Deutsche Boerse AG | Citibank | 62.474 | (203.128) | Securitas AB 'B' | Barclays Bank | 77.709 |
| (41.888) | Deutsche Post AG Reg | JP Morgan | (18.012) | (92.528) | SKF AB 'B' | Barclays Bank | 124.769 |
| (122.781) | ElringKlinger AG | Citibank | 109.921 | (76.149) | Viaplay Group AB | JP Morgan | 178.205 |
| (83.971) | ElringKlinger AG | JP Morgan | 143.436 | (329.036) | Volvo Car AB 'B' | JP Morgan | 41.959 |
| (7.223) | Evotec SE | JP Morgan | (26.797) | | | | 2.052.108 |
| (48.215) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Barclays Bank | 133.555 | Schweiz | | | |
| | | | | (53.310) | ABB Ltd Reg | Barclays Bank | (547) |
| | | | | (1.456) | EMS-Chemie Holding AG Reg | JP Morgan | 29.135 |
| | | | | (7.264) | Kuehne + Nagel International AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 17.890 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Opportunities Extension Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------------------------|-----------------|---|
| Schweiz Fortsetzung | | | |
| 34.881 | Medartis Holding AG | Citibank | 28.636 |
| 39.311 | Sika AG Reg | JP Morgan | 98.873 |
| (3.021) | Sonova Holding AG Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 136.715 |
| (6.683) | Swatch Group AG | JP Morgan | 194.081 |
| | | | 504.783 |
| Großbritannien | | | |
| (702.213) | abrdn Plc | BNP Paribas | 56.988 |
| (113.910) | Antofagasta Plc | Barclays Bank | 93.104 |
| 106.582 | Ashtead Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 127.273 |
| (71.397) | Associated British Foods Plc | Barclays Bank | 53.389 |
| 1.160.194 | Auto Trader Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (24.211) |
| 607.571 | BP Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (189.129) |
| (129.024) | Carnival Plc | JP Morgan | (82.271) |
| 506.965 | Compass Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 282.121 |
| 420.405 | CVS Group Plc | Barclays Bank | (197.057) |
| 352.181 | Experian Plc | JP Morgan | 203.250 |
| (378.168) | Glencore Plc | JP Morgan | 145.997 |
| 336.042 | Halma Plc | BNP Paribas | (195.259) |
| (1.145.814) | ITV Plc | Barclays Bank | 22.836 |
| (188.330) | J Sainsbury Plc | Citibank | 15.721 |
| (75.072) | Johnson Matthey Plc | BNP Paribas | 171.556 |
| (264.409) | Kingfisher Plc | JP Morgan | 68.666 |
| (904.470) | Marks & Spencer Group Plc | Barclays Bank | (171.971) |
| (3.528.710) | N Brown Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (9.818) |
| 278.409 | Shell Plc | Barclays Bank | (505.142) |
| 56.837 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (82.368) |
| (993.795) | Spirent Communications Plc | BNP Paribas | (25.348) |
| (1.740.750) | THG Plc | Barclays Bank | (58.123) |
| (34.738) | TUI AG | Citibank | 7.370 |
| (37.327) | TUI AG | JP Morgan | 21.594 |
| 1.412.256 | Volusion Group Plc | Barclays Bank | (6.549) |
| | | | (277.381) |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| (54.632) | Carnival Corp | Citibank | (5.117) |
| | | | (5.117) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – EUR 283.082.063) | | | 183.965 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Opportunities Extension Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| GBP | 93.285.418 | EUR | 107.160.049 | State Street Bank & Trust Company | 16/6/2023 | 935.222 |
| NOK | 56.112.980 | EUR | 4.841.164 | State Street Bank & Trust Company | 16/6/2023 | (131.487) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 112.804.948) | | | | | | 803.735 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 33,34 |
| Industrie | 16,15 |
| Finanzen | 11,50 |
| Technologie | 9,37 |
| Zyklische Konsumgüter | 8,88 |
| Grundstoffe | 8,81 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 6,38 |
| Energie | 3,05 |
| Versorger | 0,94 |
| Kommunikation | 0,78 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,20 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,80 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Schweden | | | |
| STAMMAKTIE | | | | 26.884 | Alfa Laval AB [^] | 903.626 | 0,29 |
| Österreich | | | | 65.384 | Epiroc AB 'A' | 1.068.986 | 0,34 |
| 29.387 | BAWAG Group AG | 1.196.639 | 0,38 | 332.128 | Tele2 AB 'B' | 2.802.179 | 0,90 |
| | | 1.196.639 | 0,38 | 82.487 | Volvo AB 'B' | 1.428.567 | 0,46 |
| Belgien | | | | Schweiz | | | |
| 18.546 | Azelis Group NV | 424.703 | 0,14 | 3.821 | Lonza Group AG Reg [^] | 2.234.219 | 0,71 |
| 12.544 | KBC Group NV | 765.435 | 0,24 | 24.521 | Nestle SA Reg | 2.741.773 | 0,88 |
| | | 1.190.138 | 0,38 | 10.260 | Roche Holding AG | 3.022.782 | 0,97 |
| Dänemark | | | | 5.324 | Sika AG Reg [^] | 1.366.401 | 0,44 |
| 9.881 | Carlsberg A/S 'B' | 1.401.655 | 0,45 | 3.248 | Zurich Insurance Group AG [^] | 1.446.545 | 0,46 |
| 16.668 | Novo Nordisk A/S 'B' | 2.501.603 | 0,80 | Großbritannien | | | |
| 136.187 | Tryg A/S [^] | 2.917.448 | 0,94 | 18.546 | AstraZeneca Plc | 2.510.500 | 0,80 |
| | | 6.820.706 | 2,19 | 121.593 | Barclays Plc | 213.907 | 0,07 |
| Finnland | | | | 308.807 | BP Plc | 1.628.438 | 0,52 |
| 61.442 | Sampo Oyj 'A' | 2.646.307 | 0,85 | 263.771 | Haleon Plc | 979.031 | 0,31 |
| | | 2.646.307 | 0,85 | 308.063 | Phoenix Group Holdings Plc | 2.007.919 | 0,64 |
| Frankreich | | | | 24.877 | RELX Plc | 731.991 | 0,24 |
| 37.117 | ALD SA | 374.140 | 0,12 | 67.030 | Shell Plc | 1.739.571 | 0,56 |
| 51.569 | BNP Paribas SA | 2.805.869 | 0,90 | Gesamt Stammaktien | | | |
| 34.199 | Cie de Saint-Gobain | 1.785.530 | 0,57 | 73.985.169 23,69 | | | |
| 148.970 | Engie SA | 2.099.583 | 0,67 | ANLEIHEN | | | |
| 33.200 | Euroapi SA | 327.020 | 0,11 | Australien | | | |
| 2.115 | L'Oreal SA | 845.154 | 0,27 | EUR 100.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 0,75% 15/3/2029 | 81.531 | 0,03 |
| 2.060 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 1.678.282 | 0,54 | EUR 550.000 | APA Infrastructure Ltd RegS 2,00% 15/7/2030 | 468.638 | 0,15 |
| 31.770 | Sanofi | 3.013.067 | 0,96 | 550.169 0,18 | | | |
| 15.292 | Schneider Electric SE | 2.491.984 | 0,80 | Österreich | | | |
| 27.012 | Vinci SA | 2.887.583 | 0,92 | EUR 200.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 186.076 | 0,06 |
| | | 18.308.212 | 5,86 | EUR 300.000 | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 4,125% 18/1/2027 [^] | 298.800 | 0,10 |
| Deutschland | | | | EUR 100.000 | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 2,00% 25/8/2032 | 89.807 | 0,03 |
| 43.101 | Deutsche Bank AG | 408.856 | 0,13 | EUR 100.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 95.142 | 0,03 |
| 6.678 | MTU Aero Engines AG | 1.451.797 | 0,47 | EUR 200.000 | Raiffeisen Bank International AG RegS FRN 26/1/2027 | 197.476 | 0,06 |
| 32.575 | RWE AG [^] | 1.283.781 | 0,41 | EUR 300.000 | Raiffeisenlandesbank Niederösterreich-Wien AG RegS 1,25% 21/4/2027 | 277.464 | 0,09 |
| 9.310 | Siemens AG Reg | 1.432.995 | 0,46 | EUR 1.200.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,50% 20/4/2027 | 1.105.080 | 0,35 |
| | | 4.577.429 | 1,47 | EUR 300.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 20/10/2028 (Zero Coupon) | 259.788 | 0,08 |
| Irland | | | | EUR 530.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 20/2/2030 (Zero Coupon) | 440.827 | 0,14 |
| 160.586 | AIB Group Plc | 614.402 | 0,20 | EUR 215.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,90% 20/2/2033 | 214.413 | 0,07 |
| 24.584 | CRH Plc | 1.093.988 | 0,35 | EUR 410.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 4,15% 15/3/2037 | 456.293 | 0,15 |
| 2.691 | Linde Plc (traded in Germany) | 892.605 | 0,28 | | | | |
| 1.691 | Linde Plc (traded in United States) | 561.486 | 0,18 | | | | |
| | | 3.162.481 | 1,01 | | | | |
| Italien | | | | | | | |
| 88.645 | Intesa Sanpaolo SpA | 192.404 | 0,06 | | | | |
| 122.371 | UniCredit SpA [^] | 2.221.278 | 0,71 | | | | |
| | | 2.413.682 | 0,77 | | | | |
| Niederlande | | | | | | | |
| 3.709 | ASML Holding NV | 2.510.622 | 0,80 | | | | |
| 35.520 | ASR Nederland NV [^] | 1.417.958 | 0,45 | | | | |
| 36.860 | STMicroelectronics NV [^] | 1.512.182 | 0,49 | | | | |
| | | 5.440.762 | 1,74 | | | | |
| Norwegen | | | | | | | |
| 37.567 | Gjensidige Forsikring ASA | 585.595 | 0,19 | | | | |
| | | 585.595 | 0,19 | | | | |
| Spanien | | | | | | | |
| 26.062 | Industria de Diseno Textil SA | 816.783 | 0,26 | | | | |
| | | 816.783 | 0,26 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Österreich Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| EUR 300.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,85% 23/5/2049 | 232.248 | 0,07 | EUR 700.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 26/4/2027 | 618.419 | 0,20 |
| EUR 86.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 3,80% 26/1/2062 | 99.584 | 0,03 | | | 3.228.779 | 1,03 |
| EUR 161.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,10% 20/9/2117 | 117.590 | 0,04 | Zypern | | | |
| | | 4.070.588 | 1,30 | EUR 277.000 | Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023 | 277.601 | 0,09 |
| Belgien | | | | | | 277.601 | 0,09 |
| EUR 800.000 | Argenta Spaarbank NV RegS 1,00% 6/2/2024 | 784.024 | 0,25 | Tschechische Republik | | | |
| EUR 300.000 | Argenta Spaarbank NV RegS FRN 29/11/2027 | 299.139 | 0,10 | CZK 19.000.000 | Czech Republic Government Bond 1,75% 23/6/2032 | 641.626 | 0,21 |
| EUR 100.000 | Belfius Bank SA RegS FRN 6/4/2034 | 79.291 | 0,03 | | | 641.626 | 0,21 |
| EUR 100.000 | KBC Group NV RegS 0,75% 24/1/2030 | 80.360 | 0,03 | Dänemark | | | |
| EUR 1.110.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2028* | 1.016.915 | 0,33 | EUR 500.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 15/5/2031 | 441.125 | 0,14 |
| EUR 525.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,90% 22/6/2029 | 474.511 | 0,15 | DKK 3.292.000 | Denmark Government Bond 4,50% 15/11/2039 | 549.766 | 0,18 |
| EUR 150.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,25% 22/4/2033 | 129.542 | 0,04 | EUR 100.000 | Kommunekredit RegS 0,875% 3/11/2036 | 75.025 | 0,02 |
| EUR 589.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,00% 22/6/2033 | 590.961 | 0,19 | DKK 0 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 |
| EUR 842.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 2,75% 22/4/2039 | 786.958 | 0,25 | GBP 355.000 | Orsted AS RegS 4,875% 12/1/2032 | 390.465 | 0,13 |
| EUR 282.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,45% 22/6/2043 | 284.372 | 0,09 | DKK 1 | Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050 | — | 0,00 |
| EUR 451.264 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,60% 22/6/2047 | 319.779 | 0,10 | | | 1.456.381 | 0,47 |
| EUR 111.800 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,40% 22/6/2053 | 70.060 | 0,02 | Estland | | | |
| EUR 273.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,30% 22/6/2054 | 263.461 | 0,08 | EUR 450.000 | Luminor Bank AS/Estonia RegS FRN 29/8/2024 | 450.000 | 0,14 |
| EUR 70.004 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,65% 22/6/2071 | 28.346 | 0,01 | | | 450.000 | 0,14 |
| EUR 194.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS (traded in Belgium) 0,35% 22/6/2032 | 155.200 | 0,05 | Finnland | | | |
| EUR 50.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS (traded in Germany) 0,35% 22/6/2032 | 40.000 | 0,01 | EUR 559.000 | Finland Government Bond RegS 3,00% 15/9/2033 | 564.456 | 0,18 |
| | | 5.402.919 | 1,73 | EUR 65.000 | Finland Government Bond RegS 2,75% 15/4/2038 | 62.013 | 0,02 |
| Kanada | | | | EUR 75.000 | Finland Government Bond RegS 0,25% 15/9/2040 | 46.615 | 0,01 |
| EUR 660.000 | Bank of Montreal RegS 3,375% 4/7/2026 | 657.553 | 0,21 | EUR 150.000 | Finland Government Bond RegS 0,50% 15/4/2043 | 92.376 | 0,03 |
| EUR 342.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 14/9/2029 | 278.344 | 0,09 | EUR 57.000 | Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047 | 41.464 | 0,01 |
| EUR 514.000 | CPPIB Capital Inc RegS 0,375% 20/6/2024 | 496.724 | 0,16 | EUR 377.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 16/6/2028 | 312.518 | 0,10 |
| EUR 680.000 | CPPIB Capital Inc RegS 0,875% 6/2/2029 | 598.890 | 0,19 | EUR 200.000 | OP Corporate Bank Plc RegS FRN 9/6/2030 | 185.232 | 0,06 |
| EUR 575.000 | National Bank of Canada RegS 3,50% 25/4/2028 | 578.849 | 0,18 | EUR 372.000 | OP Mortgage Bank RegS 2,75% 25/1/2030 | 363.968 | 0,12 |
| | | | | | | 1.668.642 | 0,53 |
| | | | | Frankreich | | | |
| | | | | EUR 1.100.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,00% 31/1/2028 | 1.004.388 | 0,32 |
| | | | | EUR 1.200.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 3,375% 25/5/2033 | 1.214.004 | 0,39 |
| | | | | EUR 400.000 | Arkea Home Loans SFH SA RegS 3,00% 30/3/2027 | 396.360 | 0,13 |
| | | | | EUR 300.000 | AXA Home Loan SFH SA RegS 0,01% 16/10/2029 | 246.339 | 0,08 |
| | | | | EUR 350.000 | AXA SA RegS FRN 11/7/2043 | 350.679 | 0,11 |
| | | | | EUR 500.000 | AXA SA RegS FRN 28/5/2049 | 452.815 | 0,15 |
| | | | | EUR 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,01% 7/3/2025 | 280.374 | 0,09 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | |
| EUR 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1,00% 23/5/2025 | 284.274 | 0,09 | EUR 200.000 | Electricite de France SA RegS 1,00% 29/11/2033* | 144.678 | 0,05 |
| EUR 1.800.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 5,125% 13/1/2033 | 1.794.870 | 0,57 | EUR 900.000 | Electricite de France SA RegS 4,625% 25/1/2043 | 857.088 | 0,27 |
| EUR 1.000.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025 | 959.520 | 0,31 | EUR 200.000 | Engie SA RegS 2,00% 28/9/2037 | 154.334 | 0,05 |
| EUR 200.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 11/7/2030 | 162.748 | 0,05 | EUR 56.495 | FCT Autonoria '2019-1 B' RegS FRN 25/9/2035 | 56.417 | 0,02 |
| EUR 1.200.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 1.078.500 | 0,35 | EUR 132.829 | FCT Noria '2021-1 C' RegS FRN 25/10/2049 | 130.696 | 0,04 |
| GBP 200.000 | Bouygues SA RegS 5,50% 6/10/2026 | 231.124 | 0,07 | EUR 3.380.000 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2025 (Zero Coupon) | 3.216.814 | 1,03 |
| EUR 200.000 | Bouygues SA RegS 5,375% 30/6/2042 | 218.918 | 0,07 | EUR 200.000 | France Government Bond OAT RegS 25/3/2025 (Zero Coupon)* | 190.070 | 0,06 |
| EUR 200.000 | BPCE SA RegS 2,25% 12/3/2025 | 192.246 | 0,06 | EUR 770.000 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2026 (Zero Coupon)* | 715.815 | 0,23 |
| EUR 400.000 | BPCE SA RegS 4,00% 29/11/2032 | 399.828 | 0,13 | EUR 2.915.000 | France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/2/2028 | 2.674.425 | 0,86 |
| EUR 600.000 | BPCE SA RegS FRN 2/2/2034 | 491.220 | 0,16 | EUR 294.000 | France Government Bond OAT RegS 2,75% 25/2/2029 | 295.350 | 0,09 |
| EUR 200.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 142.770 | 0,05 | EUR 275.000 | France Government Bond OAT RegS 2,00% 25/11/2032* | 257.285 | 0,08 |
| EUR 800.000 | BPCE SFH SA RegS 3,25% 12/4/2028 | 800.504 | 0,26 | EUR 425.000 | France Government Bond OAT RegS 1,25% 25/5/2038 | 329.753 | 0,11 |
| EUR 900.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 16/10/2028 | 760.455 | 0,24 | EUR 1.898.623 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2040 | 1.235.168 | 0,40 |
| EUR 900.000 | BPCE SFH SA RegS 3,00% 17/10/2029 | 890.946 | 0,29 | EUR 170.000 | France Government Bond OAT RegS 2,50% 25/5/2043^ | 150.958 | 0,05 |
| EUR 300.000 | BPCE SFH SA RegS 3,125% 20/1/2033 | 296.964 | 0,10 | EUR 217.000 | France Government Bond OAT RegS 4,00% 25/4/2060 | 248.380 | 0,08 |
| EUR 500.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 3,90% 20/10/2023 | 500.710 | 0,16 | EUR 415.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/5/2066 | 278.374 | 0,09 |
| EUR 600.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA RegS 3,125% 23/2/2033 | 596.550 | 0,19 | EUR 185.276 | France Government Bond OAT RegS (traded in France) 0,50% 25/6/2044 | 109.031 | 0,04 |
| EUR 200.000 | Caisse Francaise de Financement Local RegS 1,125% 9/9/2025 | 190.140 | 0,06 | EUR 1.531.000 | France Government Bond OAT RegS (traded in France) 3,00% 25/5/2054 | 1.423.355 | 0,46 |
| EUR 300.000 | Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026 | 278.430 | 0,09 | EUR 1.926.000 | France Government Bond OAT RegS (traded in Germany) 3,00% 25/5/2054 | 1.790.583 | 0,57 |
| EUR 100.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023 | 99.200 | 0,03 | EUR 200.000 | Harmony French Home Loans FCT '2020-2 B' RegS FRN 27/8/2061 | 198.132 | 0,06 |
| EUR 200.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024 | 195.426 | 0,06 | EUR 600.000 | La Banque Postale Home Loan SFH SA RegS 3,125% 19/2/2029 | 597.852 | 0,19 |
| EUR 600.000 | Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 0,875% 29/9/2024 | 577.302 | 0,18 | EUR 1.400.000 | La Banque Postale SA RegS 4,375% 17/1/2030 | 1.381.996 | 0,44 |
| EUR 100.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 0,25% 23/2/2024 | 97.602 | 0,03 | EUR 500.000 | Societe Generale SA RegS FRN 6/12/2030 | 484.175 | 0,16 |
| EUR 800.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 2,875% 23/6/2028 | 788.456 | 0,25 | EUR 800.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 2/6/2025 | 754.736 | 0,24 |
| EUR 400.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 3,125% 16/8/2029 | 398.824 | 0,13 | EUR 700.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026 | 626.563 | 0,20 |
| EUR 200.000 | Credit Agricole SA RegS 1,375% 13/3/2025 | 191.732 | 0,06 | EUR 700.000 | Societe Generale SFH SA RegS 3,125% 24/2/2032 | 696.444 | 0,22 |
| EUR 300.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 | 255.447 | 0,08 | EUR 200.000 | Teleperformance RegS 3,75% 24/6/2029 | 192.086 | 0,06 |
| EUR 700.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 3,25% 20/4/2029 | 700.882 | 0,22 | EUR 300.000 | TotalEnergies Capital International SA RegS 0,696% 31/5/2028 | 264.303 | 0,08 |
| GBP 2.800.000 | Dexia Credit Local SA RegS 1,625% 8/12/2023 | 3.189.771 | 1,02 | EUR 200.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 189.656 | 0,06 |
| GBP 180.000 | Electricite de France SA 5,875% 18/7/2031 | 200.593 | 0,06 | EUR 509.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 424.430 | 0,14 |
| | | | | EUR 400.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 349.316 | 0,11 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|-----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | |
| EUR 300.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual) | 261.330 | 0,08 | EUR 74.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 30/9/2026 (Zero Coupon) | 67.316 | 0,02 |
| EUR 700.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 [*] | 632.506 | 0,20 | EUR 447.000 | NRW Bank 0,10% 9/7/2035 | 312.171 | 0,10 |
| EUR 400.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 330.032 | 0,11 | EUR 640.000 | NRW Bank RegS 0,625% 2/2/2029 | 562.899 | 0,18 |
| | | 42.553.042 | 13,62 | EUR 371.000 | NRW Bank RegS 0,375% 16/5/2029 | 319.264 | 0,10 |
| | Deutschland | | | EUR 389.000 | NRW Bank RegS 0,50% 17/6/2041 | 247.844 | 0,08 |
| EUR 400.000 | Allianz SE RegS FRN 7/9/2038 | 392.900 | 0,13 | EUR 87.011 | Red & Black Auto Germany UG '8 B' RegS FRN 15/9/2030 | 86.364 | 0,03 |
| EUR 200.000 | BASF SE RegS 4,25% 8/3/2032 | 207.960 | 0,07 | EUR 900.000 | Robert Bosch GmbH RegS 4,375% 2/6/2043 | 927.441 | 0,30 |
| EUR 2.425.000 | Bayer AG RegS 4,625% 26/5/2033 [*] | 2.479.878 | 0,79 | EUR 380.000 | RWE AG RegS 2,75% 24/5/2030 | 352.549 | 0,11 |
| EUR 500.000 | Bayer AG RegS FRN 25/3/2082 | 461.710 | 0,15 | EUR 10.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 1,625% 24/10/2030 | 9.153 | 0,00 |
| EUR 400.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 313.744 | 0,10 | EUR 676.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,60% 4/6/2041 | 434.235 | 0,14 |
| EUR 215.000 | Bundesobligation RegS 2,20% 13/4/2028 [*] | 214.228 | 0,07 | EUR 300.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,50% 15/1/2052 | 150.525 | 0,05 |
| EUR 4.747.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 2,30% 15/2/2033 | 4.761.194 | 1,52 | EUR 90.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 3,40% 7/3/2073 | 92.977 | 0,03 |
| EUR 192.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,80% 15/8/2053 | 165.181 | 0,05 | EUR 425.000 | Volkswagen Financial Services AG RegS 1,50% 1/10/2024 [*] | 412.620 | 0,13 |
| EUR 700.000 | Commerzbank AG RegS FRN 18/1/2030 | 699.503 | 0,22 | EUR 90.000 | Volkswagen Financial Services AG RegS 0,875% 31/1/2028 | 77.759 | 0,03 |
| EUR 100.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS 1,125% 29/5/2051 | 57.002 | 0,02 | EUR 200.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 1,375% 20/1/2025 | 191.526 | 0,06 |
| EUR 200.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/5/2028 | 185.024 | 0,06 | EUR 183.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,375% 20/7/2026 | 163.992 | 0,05 |
| EUR 500.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 11/1/2029 [*] | 497.085 | 0,16 | EUR 100.000 | Vonovia SE RegS 5,00% 23/11/2030 | 96.194 | 0,03 |
| EUR 800.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 5/9/2030 | 773.936 | 0,25 | EUR 200.000 | Vonovia SE RegS 2,375% 25/3/2032 [*] | 161.050 | 0,05 |
| EUR 400.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 356.192 | 0,11 | | | 21.069.399 | 6,75 |
| EUR 800.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN (Perpetual) | 639.032 | 0,20 | | Ungarn | | |
| EUR 400.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 17/1/2025 | 367.248 | 0,12 | EUR 600.000 | Erste Bank Hungary Zrt RegS FRN 4/2/2026 | 548.520 | 0,18 |
| EUR 500.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 442.565 | 0,14 | HUF 200.000.000 | Hungary Government Bond 2,00% 23/5/2029 | 388.165 | 0,12 |
| EUR 300.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023 | 297.465 | 0,10 | | | 936.685 | 0,30 |
| EUR 300.000 | FMS Wertmanagement RegS 0,375% 29/4/2030 | 252.486 | 0,08 | | Irland | | |
| EUR 103.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028 | 92.012 | 0,03 | EUR 425.000 | Abbott Ireland Financing DAC RegS 0,10% 19/11/2024 | 404.357 | 0,13 |
| EUR 400.000 | Gemeinsame Deutsche Bundeslaender RegS 0,75% 25/9/2028 | 358.272 | 0,12 | GBP 378.858 | Agora Securities UK '2021-1X A' DAC RegS FRN 22/7/2031 | 424.956 | 0,14 |
| EUR 765.000 | Gemeinsame Deutsche Bundeslaender RegS 0,625% 13/2/2029 | 674.393 | 0,22 | EUR 375.000 | AIB Group Plc RegS FRN 16/2/2029 | 388.987 | 0,13 |
| EUR 600.000 | Hamburg Commercial Bank AG RegS FRN 22/9/2026 | 500.748 | 0,16 | EUR 400.000 | AIB Group Plc RegS FRN 23/7/2029 | 394.860 | 0,13 |
| EUR 600.000 | Hannover Rueck SE RegS FRN 26/8/2043 | 624.744 | 0,20 | EUR 700.000 | Bank of Ireland Mortgage Bank RegS 0,625% 14/3/2025 | 665.105 | 0,21 |
| EUR 390.000 | Heidelberg Materials AG RegS 3,75% 31/5/2032 | 377.231 | 0,12 | EUR 277.920 | Haus European Loan Conduit '39X A1' DAC RegS FRN 28/7/2051 | 261.245 | 0,08 |
| EUR 113.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125% 4/10/2024 | 108.550 | 0,04 | EUR 350.000 | Ireland Government Bond RegS 18/10/2031 (Zero Coupon) | 280.165 | 0,09 |
| EUR 114.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,50% 15/9/2027 | 103.237 | 0,03 | EUR 305.000 | Ireland Government Bond RegS 1,30% 15/5/2033 [*] | 265.719 | 0,09 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------|---|------------------------|--------------------|----------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Irland Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| EUR 50.000 | Ireland Government Bond RegS 0,55% 22/4/2041 | 32.200 | 0,01 | EUR 625.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,00% 1/8/2039 | 666.694 | 0,21 |
| EUR 165.000 | Ireland Government Bond RegS 3,00% 18/10/2043 | 160.350 | 0,05 | EUR 665.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,45% 1/9/2043 | 659.135 | 0,21 |
| EUR 270.000 | Ireland Government Bond RegS 1,50% 15/5/2050 | 185.976 | 0,06 | EUR 1.587.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045 | 950.232 | 0,30 |
| EUR 268.945 | Last Mile Securities PE '2021-1X A1' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 260.388 | 0,08 | EUR 380.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,50% 1/10/2053 | 374.870 | 0,12 |
| EUR 200.000 | LT Autorahoitus '3 B' DAC RegS FRN 17/12/2032 | 202.140 | 0,07 | EUR 350.000 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 0,50% 1/10/2026 | 317.769 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Lt Autorahoitus '4 B' DAC RegS FRN 18/7/2033 | 100.234 | 0,03 | EUR 77.873 | Progetto Quinto '1 A' Srl RegS FRN 27/10/2036 | 77.448 | 0,02 |
| GBP 170.963 | Taurus '2019-UK2 A' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 195.829 | 0,06 | EUR 116.000 | Snam SpA RegS 0,625% 30/6/2031 | 89.311 | 0,03 |
| GBP 94.980 | Taurus '2019-UK2 B' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 107.362 | 0,03 | EUR 725.000 | UniCredit SpA RegS FRN 23/9/2029 | 682.225 | 0,22 |
| GBP 94.980 | Taurus '2019-UK2 C' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 106.532 | 0,03 | | | 14.835.628 | 4,75 |
| GBP 300.000 | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co RegS FRN 23/11/2052 | 306.601 | 0,10 | | | | |
| | | 4.743.006 | 1,52 | | | | |
| Italien | | | | Japan | | | |
| EUR 300.000 | AZA SpA RegS 4,375% 3/2/2034 | 299.145 | 0,10 | EUR 364.000 | Nissan Motor Co Ltd RegS 3,201% 17/9/2028 | 329.227 | 0,11 |
| EUR 335.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028 | 296.941 | 0,09 | EUR 325.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd RegS 3,629% 6/4/2026 | 324.324 | 0,10 |
| EUR 100.000 | ASTM SpA RegS 1,50% 25/1/2030 | 81.304 | 0,03 | | | 653.551 | 0,21 |
| EUR 725.000 | ASTM SpA RegS 2,375% 25/11/2033 | 565.703 | 0,18 | Lettland | | | |
| EUR 26.512 | AutoFlorence '1 A' Srl RegS FRN 25/12/2042 | 26.523 | 0,01 | EUR 100.000 | Latvia Government International Bond RegS 3,50% 17/1/2028 | 99.664 | 0,03 |
| EUR 19.785 | AutoFlorence '1 B' Srl RegS FRN 25/12/2042 | 19.741 | 0,01 | | | 99.664 | 0,03 |
| EUR 124.544 | Autoflorence '2 B' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 122.387 | 0,04 | Litauen | | | |
| EUR 100.000 | AutoFlorence '3 B' Srl RegS FRN 25/12/2046 | 100.000 | 0,03 | EUR 200.000 | Lithuania Government International Bond RegS 2,125% 1/6/2032 | 175.838 | 0,06 |
| EUR 600.000 | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 0,875% 8/10/2026 | 540.504 | 0,17 | | | 175.838 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Brignole Co '2021 B' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 98.949 | 0,03 | Luxemburg | | | |
| EUR 675.000 | Credito Emiliano SpA RegS 1,125% 17/1/2024 | 663.484 | 0,21 | EUR 255.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1,336% 13/8/2041 | 161.897 | 0,05 |
| EUR 450.000 | Enel SpA RegS FRN 31/12/2099 | 453.064 | 0,14 | EUR 300.000 | Bumper De SA '2023-DE1 A' RegS FRN 23/8/2032 | 300.444 | 0,10 |
| EUR 500.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 425.805 | 0,14 | EUR 110.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,75% 3/5/2027 | 101.305 | 0,03 |
| EUR 543.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 504.105 | 0,16 | EUR 2.355.000 | European Financial Stability Facility RegS 3,00% 15/12/2028 | 2.364.538 | 0,76 |
| EUR 100.000 | Eni SpA RegS FRN (Perpetual) | 84.392 | 0,03 | EUR 638.000 | European Financial Stability Facility RegS 20/1/2031 (Zero Coupon) | 512.161 | 0,16 |
| EUR 500.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024 | 488.010 | 0,16 | EUR 93.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,875% 10/4/2035 | 72.484 | 0,02 |
| EUR 300.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 5,25% 13/1/2030 | 308.817 | 0,10 | EUR 116.000 | European Financial Stability Facility RegS 1,375% 31/5/2047 | 80.763 | 0,03 |
| EUR 1.685.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,40% 1/4/2028 | 1.675.513 | 0,54 | EUR 500.000 | European Financial Stability Facility RegS 1,80% 10/7/2048 | 373.115 | 0,12 |
| EUR 2.909.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,00% 30/4/2035 | 2.839.504 | 0,91 | EUR 51.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,70% 20/1/2050 | 27.834 | 0,01 |
| EUR 380.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,25% 1/3/2038 | 333.651 | 0,11 | EUR 700.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,70% 17/1/2053* | 358.211 | 0,11 |
| EUR 1.053.427 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,40% 15/5/2039 | 1.090.402 | 0,35 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Luxemburg Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | |
| EUR 500.000 | European Financial Stability Facility RegS 1,75% 17/7/2053* | 350.925 | 0,11 | EUR 200.000 | ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN 31/12/2099* | 191.770 | 0,06 |
| EUR 450.000 | Medtronic Global Holdings SCA 0,25% 2/7/2025 | 420.619 | 0,13 | EUR 225.000 | EnBW International Finance BV RegS 4,049% 22/11/2029 | 229.761 | 0,07 |
| EUR 90.602 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 D' RegS FRN 14/11/2034 | 89.042 | 0,03 | USD 775.000 | Enel Finance International NV RegS 7,50% 14/10/2032 | 806.073 | 0,26 |
| EUR 125.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,875% 23/3/2030 | 104.270 | 0,03 | USD 200.000 | Enel Finance International NV RegS 7,75% 15/10/2052 | 214.726 | 0,07 |
| EUR 325.000 | SELP Finance Sarl RegS 3,75% 10/8/2027 | 303.511 | 0,10 | EUR 900.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099* | 816.192 | 0,26 |
| EUR 450.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 371.205 | 0,12 | EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 285.207 | 0,09 |
| EUR 47.000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg RegS 3,00% 2/3/2033 | 47.509 | 0,02 | EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 1/2/2030 | 159.318 | 0,05 |
| EUR 64.000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg RegS 3,25% 2/3/2043 | 65.290 | 0,02 | EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 24/8/2033 | 191.040 | 0,06 |
| | | 6.105.123 | 1,95 | EUR 400.000 | ING Groep NV RegS (traded in Germany) FRN 18/2/2029 | 330.448 | 0,11 |
| | Montenegro | | | EUR 200.000 | ING Group NV RegS FRN 23/5/2034 | 201.924 | 0,07 |
| EUR 500.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027 | 410.846 | 0,13 | EUR 78.457 | Jubilee Place '2020-1 A' BV RegS FRN 17/10/2057 | 78.586 | 0,03 |
| EUR 100.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,55% 3/10/2029 | 74.724 | 0,03 | EUR 108.000 | Jubilee Place '3 B' RegS FRN 17/1/2059 | 104.884 | 0,03 |
| | | 485.570 | 0,16 | EUR 300.000 | Nationale-Nederlanden Bank NV RegS 0,50% 10/10/2024 | 287.571 | 0,09 |
| | Niederlande | | | EUR 200.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 175.340 | 0,06 |
| EUR 500.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,375% 20/10/2028 | 499.975 | 0,16 | EUR 1.072.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2026 (Zero Coupon) | 1.000.787 | 0,32 |
| EUR 1.000.000 | ABN AMRO Bank NV RegS FRN 22/2/2033 | 988.440 | 0,32 | EUR 1.000.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,75% 15/7/2027 | 931.660 | 0,30 |
| EUR 100.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,50% 21/11/2034 | 101.026 | 0,03 | EUR 270.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,50% 15/7/2033 | 266.722 | 0,09 |
| EUR 200.000 | Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025 | 186.380 | 0,06 | EUR 195.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,50% 15/1/2040 | 136.231 | 0,04 |
| EUR 200.000 | Achmea Bank NV RegS 3,00% 31/1/2030 | 198.034 | 0,06 | EUR 685.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,75% 15/1/2047 | 689.480 | 0,22 |
| EUR 300.000 | Aegon Bank NV RegS 0,01% 16/11/2025 | 275.913 | 0,09 | EUR 450.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 421.907 | 0,14 |
| EUR 447.000 | BNG Bank NV RegS 0,75% 11/1/2028 | 404.405 | 0,13 | EUR 475.000 | Shell International Finance BV RegS 1,875% 7/4/2032 | 414.157 | 0,13 |
| EUR 820.000 | BNG Bank NV RegS 3,00% 23/4/2030 | 820.443 | 0,26 | EUR 100.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 98.932 | 0,03 |
| EUR 339.000 | BNG Bank NV RegS 0,125% 19/4/2033 | 255.840 | 0,08 | EUR 100.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 102.108 | 0,03 |
| EUR 500.000 | BNG Bank NV RegS 1,50% 29/3/2038 | 399.170 | 0,13 | EUR 485.000 | TenneT Holding BV RegS 4,50% 28/10/2034 | 521.070 | 0,17 |
| EUR 300.000 | BNG Bank NV RegS 0,805% 28/6/2049 | 167.682 | 0,05 | EUR 1.100.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7,875% 15/9/2031 | 1.126.499 | 0,36 |
| EUR 100.000 | BP Capital Markets BV RegS 1,467% 21/9/2041 | 64.081 | 0,02 | EUR 135.000 | Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1,625% 18/10/2041 | 93.957 | 0,03 |
| EUR 300.000 | de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024 | 285.945 | 0,09 | EUR 500.000 | Universal Music Group NV RegS (traded in International) 3,75% 30/6/2032 | 491.540 | 0,16 |
| EUR 700.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 657.685 | 0,21 | EUR 100.000 | Volkswagen International Finance NV RegS FRN 31/12/2099 | 94.293 | 0,03 |
| EUR 162.635 | Dutch Property Finance '2020-2 A' BV RegS FRN 28/1/2058 | 162.527 | 0,05 | EUR 100.000 | Vonovia Finance BV RegS 2,25% 7/4/2030 | 82.307 | 0,03 |
| EUR 206.340 | Dutch Property Finance '2023-1 A' BV RegS FRN 28/4/2064 | 206.438 | 0,07 | | | 16.882.281 | 5,41 |
| GBP 177.000 | E.ON International Finance BV 6,375% 7/6/2032 | 212.568 | 0,07 | | Neuseeland | | |
| GBP 400.000 | E.ON International Finance BV RegS 5,875% 30/10/2037 | 451.239 | 0,14 | EUR 300.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,625% 18/10/2024 | 287.448 | 0,09 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|-----------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Neuseeland Fortsetzung | | | | Portugal Fortsetzung | | | |
| EUR 312.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031 | 244.196 | 0,08 | EUR 21.900 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,10% 15/2/2045 | 23.731 | 0,01 |
| EUR 425.000 | Australia & New Zealand International Ltd RegS 0,50% 17/1/2024 | 416.674 | 0,13 | EUR 78.770 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance '1 B' RegS FRN 28/10/2040 | 75.439 | 0,02 |
| EUR 475.000 | Chorus Ltd 3,625% 7/9/2029 | 465.348 | 0,15 | EUR 49.761 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta '7 SEN' RegS 0,70% 12/2/2024 | 49.010 | 0,02 |
| EUR 320.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 | 316.688 | 0,10 | | | 1.822.240 | 0,58 |
| NZD 499.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040 | 345.811 | 0,11 | | | | |
| | | 2.076.165 | 0,66 | | | | |
| Norwegen | | | | Singapur | | | |
| EUR 1.000.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 31/5/2026* | 955.990 | 0,31 | USD 615.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,30% 19/5/2053 | 587.299 | 0,19 |
| EUR 325.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 21/9/2027 | 318.451 | 0,10 | | | 587.299 | 0,19 |
| EUR 200.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 14/1/2026 | 186.238 | 0,06 | Slowakei | | | |
| EUR 225.000 | Eika Boligkreditt AS RegS 0,50% 28/8/2025 | 210.913 | 0,07 | EUR 250.000 | Slovakia Government Bond RegS 1,00% 14/5/2032 | 203.359 | 0,07 |
| NOK 2.833.000 | Norway Government Bond RegS 1,75% 13/3/2025 | 231.185 | 0,07 | EUR 722.973 | Slovakia Government Bond RegS 4,00% 23/2/2043 | 716.811 | 0,23 |
| NOK 3.300.000 | Norway Government Bond RegS 1,75% 6/9/2029 | 253.770 | 0,08 | EUR 110.000 | Slovakia Government Bond RegS 2,00% 17/10/2047 | 78.368 | 0,02 |
| EUR 500.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025 | 475.705 | 0,15 | EUR 300.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024 | 291.444 | 0,09 |
| EUR 650.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 1,75% 25/5/2027 | 613.925 | 0,20 | EUR 400.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 23/6/2025 | 369.945 | 0,12 |
| EUR 450.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,01% 22/9/2027 | 392.292 | 0,13 | EUR 700.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 3,50% 13/10/2026 | 695.789 | 0,22 |
| EUR 50.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,125% 20/1/2028 | 43.397 | 0,01 | | | 2.355.716 | 0,75 |
| EUR 1.000.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,05% 3/11/2028 | 844.630 | 0,27 | Slowenien | | | |
| EUR 175.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 3,00% 19/5/2030 | 173.012 | 0,06 | EUR 300.000 | Slovenia Government Bond RegS 0,275% 14/1/2030 | 249.561 | 0,08 |
| EUR 975.000 | SR-Boligkreditt AS RegS 1,625% 15/3/2028 | 908.154 | 0,29 | EUR 230.000 | Slovenia Government Bond RegS 0,488% 20/10/2050 | 110.807 | 0,04 |
| EUR 300.000 | Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon) | 296.463 | 0,09 | | | 360.368 | 0,12 |
| | | 5.904.125 | 1,89 | Spanien | | | |
| Polen | | | | EUR 500.000 | Adif Alta Velocidad RegS 1,25% 4/5/2026 | 472.085 | 0,15 |
| PLN 4.000.000 | Republic of Poland Government Bond 1,25% 25/10/2030 | 642.737 | 0,21 | EUR 200.000 | Adif Alta Velocidad RegS 3,90% 30/4/2033 | 203.630 | 0,07 |
| EUR 300.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 10/2/2025 (Zero Coupon) | 281.688 | 0,09 | EUR 140.639 | Autonomia Spain '2021-SP B' FT RegS FRN 31/1/2039 | 139.032 | 0,04 |
| EUR 171.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 1,00% 25/10/2028* | 149.220 | 0,05 | EUR 95.714 | Autonomia Spain '2022-SP D' FT RegS FRN 28/1/2040 | 96.350 | 0,03 |
| EUR 300.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 2,75% 25/5/2032 | 272.350 | 0,09 | EUR 400.000 | Banco de Sabadell SA RegS 1,00% 26/4/2027 | 365.408 | 0,12 |
| EUR 50.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 4,25% 14/2/2043 | 48.312 | 0,01 | EUR 400.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,125% 10/2/2028 | 344.044 | 0,11 |
| | | 1.394.307 | 0,45 | EUR 400.000 | Banco de Sabadell SA RegS 1,75% 30/5/2029 | 364.264 | 0,12 |
| Portugal | | | | EUR 100.000 | Banco Santander SA RegS 1,00% 7/4/2025 | 95.392 | 0,03 |
| EUR 800.000 | Banco Santander Totta SA RegS 3,375% 19/4/2028 | 797.808 | 0,25 | EUR 200.000 | Banco Santander SA RegS 3,375% 11/1/2026 | 199.478 | 0,06 |
| EUR 871.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 3,50% 18/6/2038* | 876.252 | 0,28 | EUR 1.200.000 | Banco Santander SA RegS 2,375% 8/9/2027 | 1.155.216 | 0,37 |
| | | | | EUR 100.000 | Banco Santander SA RegS 0,125% 4/6/2030 | 79.990 | 0,03 |
| | | | | EUR 400.000 | Banco Santander SA RegS 0,875% 9/5/2031 | 331.264 | 0,11 |
| | | | | EUR 200.000 | Banco Santander SA RegS FRN 31/12/2099 | 132.750 | 0,04 |
| | | | | EUR 188.978 | BBVA Consumer Auto '2020-1 A' FTA RegS FRN 20/1/2036 | 189.287 | 0,06 |
| | | | | EUR 500.000 | CaixaBank SA RegS FRN 14/11/2030 | 516.555 | 0,17 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|--|--|------------------------|--------------------|
| Spanien Fortsetzung | | | | Supranationale Anleihen Fortsetzung | | | |
| EUR 500.000 | CaixaBank SA RegS FRN 30/5/2034 | 502.375 | 0,16 | EUR 100.000 | European Stability Mechanism RegS 0,75% 5/9/2028 | 89.647 | 0,03 |
| EUR 400.000 | Caja Rural de Navarra SCC RegS 0,625% 1/12/2023 | 393.900 | 0,13 | EUR 260.000 | European Stability Mechanism RegS 1,85% 1/12/2055 | 184.647 | 0,06 |
| EUR 200.000 | Caja Rural de Navarra SCC RegS 0,875% 8/5/2025 | 189.692 | 0,06 | EUR 1.800.000 | European Union RegS 0,80% 4/7/2025 | 1.717.686 | 0,55 |
| EUR 200.000 | Ibercaja Banco SA RegS 0,25% 18/10/2023 | 197.514 | 0,06 | EUR 100.000 | European Union RegS 4/10/2028 (Zero Coupon) | 85.879 | 0,03 |
| EUR 400.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024 | 385.384 | 0,12 | EUR 282.000 | European Union RegS 4/7/2035 (Zero Coupon) | 194.645 | 0,06 |
| EUR 655.000 | Spain Government Bond 2,80% 31/5/2026 | 650.847 | 0,21 | EUR 703.000 | European Union RegS 0,45% 4/7/2041 | 431.558 | 0,14 |
| EUR 115.000 | Spain Government Bond 31/1/2027 (Zero Coupon) | 103.349 | 0,03 | EUR 1.274.000 | European Union RegS 3,375% 4/11/2042 | 1.276.000 | 0,41 |
| EUR 590.000 | Spain Government Bond 31/1/2028 (Zero Coupon) | 515.141 | 0,16 | EUR 744.000 | European Union RegS 2,625% 4/2/2048 | 657.019 | 0,21 |
| EUR 1.620.000 | Spain Government Bond (traded in Spain) 0,80% 30/7/2029 | 1.418.164 | 0,45 | EUR 420.000 | European Union RegS 0,70% 6/7/2051* | 224.498 | 0,07 |
| EUR 536.000 | Spain Government Bond RegS 0,25% 30/7/2024 | 518.660 | 0,17 | EUR 679.925 | European Union RegS 2,50% 4/10/2052 | 569.838 | 0,18 |
| EUR 622.000 | Spain Government Bond RegS 2,75% 31/10/2024* | 621.185 | 0,20 | EUR 420.636 | European Union RegS 3,00% 4/3/2053 | 389.909 | 0,12 |
| EUR 637.000 | Spain Government Bond RegS 2,55% 31/10/2032 | 600.373 | 0,19 | EUR 106.000 | International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061 | 37.337 | 0,01 |
| EUR 1.838.000 | Spain Government Bond RegS 3,15% 30/4/2033 | 1.810.651 | 0,58 | | | 10.134.548 | 3,24 |
| EUR 150.000 | Spain Government Bond RegS 0,85% 30/7/2037 | 104.006 | 0,03 | Schweden | | | |
| EUR 542.000 | Spain Government Bond RegS 3,90% 30/7/2039 | 551.615 | 0,18 | SEK 4.700.000 | Kommuninvest I Sverige AB RegS 1,00% 12/5/2025 | 385.449 | 0,12 |
| EUR 239.000 | Spain Government Bond RegS 1,00% 30/7/2042 | 149.224 | 0,05 | EUR 225.000 | Lansforsakringar Hypotek AB RegS 0,625% 29/1/2026 | 209.266 | 0,07 |
| EUR 734.000 | Spain Government Bond RegS 3,45% 30/7/2043 | 691.112 | 0,22 | EUR 200.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 3/11/2031 | 172.246 | 0,06 |
| EUR 57.000 | Spain Government Bond RegS 5,15% 31/10/2044 | 67.792 | 0,02 | EUR 950.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024 | 913.197 | 0,29 |
| EUR 582.000 | Spain Government Bond RegS 2,70% 31/10/2048 | 472.311 | 0,15 | SEK 15.000.000 | Stadshypotek AB RegS 1,50% 1/6/2023 | 1.292.439 | 0,41 |
| EUR 858.000 | Spain Government Bond RegS 1,90% 31/10/2052 | 554.174 | 0,18 | EUR 150.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,125% 18/6/2024 | 144.498 | 0,05 |
| | | 15.182.214 | 4,86 | EUR 700.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 1,375% 23/2/2029 | 601.811 | 0,19 |
| Supranationale Anleihen | | | | SEK 2.000.000 | Sveriges Sakerställda Obligationer AB RegS 1,00% 21/6/2023 | 172.096 | 0,06 |
| EUR 500.000 | African Development Bank 0,50% 21/3/2029 | 434.382 | 0,14 | EUR 100.000 | Swedbank AB RegS 0,25% 2/11/2026 | 88.597 | 0,03 |
| EUR 59.000 | European Investment Bank 0,10% 15/10/2026 | 53.771 | 0,02 | EUR 1.050.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 945.683 | 0,30 |
| EUR 44.000 | European Investment Bank 2,625% 15/3/2035 | 41.988 | 0,01 | EUR 700.000 | Swedbank AB RegS FRN 20/5/2027 | 620.431 | 0,20 |
| EUR 430.000 | European Investment Bank 0,20% 17/3/2036 | 298.846 | 0,09 | SEK 2.375.000 | Sweden Government Bond RegS 3,50% 30/3/2039* | 233.316 | 0,07 |
| EUR 1.300.000 | European Investment Bank 0,50% 13/11/2037* | 904.618 | 0,29 | | | 5.779.029 | 1,85 |
| EUR 120.000 | European Investment Bank 1,50% 16/10/2048 | 83.904 | 0,03 | Schweiz | | | |
| EUR 128.000 | European Investment Bank RegS 0,375% 15/5/2026 | 118.803 | 0,04 | EUR 672.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 574.123 | 0,18 |
| EUR 99.000 | European Investment Bank RegS 0,875% 14/1/2028 | 90.658 | 0,03 | EUR 500.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 1/3/2029 | 554.150 | 0,18 |
| EUR 1.397.000 | European Investment Bank RegS 2,75% 30/7/2030* | 1.386.369 | 0,44 | EUR 2.300.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 1.987.200 | 0,64 |
| EUR 100.000 | European Investment Bank RegS 1,50% 15/6/2032 | 88.820 | 0,03 | CHF 850.000 | Swiss Confederation Government Bond RegS 0,50% 27/6/2032 | 847.643 | 0,27 |
| GBP 21.000 | European Investment Bank RegS 3,875% 8/6/2037 | 22.567 | 0,01 | CHF 721.000 | Swiss Confederation Government Bond RegS 1,50% 30/4/2042 | 814.727 | 0,26 |
| EUR 1.223.000 | European Investment Bank RegS 0,25% 15/6/2040* | 750.849 | 0,24 | | | | |
| EUR 336 | European Stability Mechanism RegS 0,75% 15/3/2027 | 310 | 0,00 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------------------|--|------------------------|--------------------|-----------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Schweiz Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| EUR 200.000 | UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026 | 184.208 | 0,06 | GBP 100.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 B' Plc RegS FRN 20/7/2058 | 112.625 | 0,04 |
| EUR 200.000 | Zuercher Kantonalbank RegS FRN 13/4/2028 | 183.298 | 0,06 | GBP 142.000 | LCR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028 | 163.922 | 0,05 |
| | | 5.145.349 | 1,65 | GBP 230.000 | Lloyds Bank Plc RegS 7,50% 15/4/2024 | 270.382 | 0,09 |
| Großbritannien | | | | GBP 100.000 | Marks & Spencer Plc RegS 4,50% 10/7/2027 | 104.076 | 0,03 |
| EUR 350.000 | Anglo American Capital Plc RegS 5,00% 15/3/2031 | 360.486 | 0,11 | GBP 250.000 | National Grid Electricity Distribution West Midlands Plc RegS 5,75% 16/4/2032 | 289.893 | 0,09 |
| EUR 425.000 | Anglo American Capital Plc RegS 4,75% 21/9/2032 | 426.403 | 0,14 | EUR 100.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 | 82.328 | 0,03 |
| GBP 100.000 | Atlas Funding '2023-1 D' Plc RegS FRN 20/1/2061 | 116.191 | 0,04 | GBP 156.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029 | 180.561 | 0,06 |
| EUR 900.000 | Barclays Plc RegS FRN 24/1/2026 | 855.144 | 0,27 | EUR 143.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082 | 122.428 | 0,04 |
| EUR 1.425.000 | Barclays Plc RegS FRN 29/1/2034 | 1.444.138 | 0,46 | GBP 295.116 | Oat Hill '2 A' Plc RegS FRN 27/5/2046 | 342.490 | 0,11 |
| EUR 219.000 | BAT International Finance Plc RegS 2,25% 16/1/2030 | 183.139 | 0,06 | EUR 26.657 | Paragon Mortgages '12X B1B' Plc RegS FRN 15/11/2038 | 24.860 | 0,01 |
| EUR 675.000 | BP Capital Markets Plc RegS 1,231% 8/5/2031 | 558.758 | 0,18 | GBP 622.984 | Parkmore Point RMBS '2022- 1X A' Plc RegS FRN 25/7/2045 | 721.505 | 0,23 |
| EUR 450.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual) | 417.227 | 0,13 | GBP 185.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 A' RegS FRN 15/10/2025 | 214.502 | 0,07 |
| EUR 667.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 | 579.269 | 0,18 | GBP 205.000 | Residential Mortgage Securities '32X C' Plc RegS FRN 20/6/2070 | 236.295 | 0,07 |
| EUR 350.000 | British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024' | 336.917 | 0,11 | GBP 76.070 | RMAC NO 2 '2018-2 A' Plc RegS FRN 12/6/2046 | 88.169 | 0,03 |
| GBP 275.000 | Cadent Finance Plc RegS 2,125% 22/9/2028 | 265.362 | 0,08 | EUR 1.600.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 25/8/2028 | 1.519.376 | 0,49 |
| GBP 400.000 | Cadent Finance Plc RegS 2,75% 22/9/2046 | 268.701 | 0,09 | EUR 1.200.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 967.032 | 0,31 |
| EUR 150.000 | Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031 | 119.814 | 0,04 | EUR 250.000 | Santander UK Plc 0,10% 12/5/2024 | 241.525 | 0,08 |
| EUR 200.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 183.184 | 0,06 | GBP 460.000 | Severn Trent Utilities Finance Plc RegS 2,75% 5/12/2031 | 432.615 | 0,14 |
| GBP 100.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 97.495 | 0,03 | GBP 78.212 | Silk Road Finance Number Six '2019-2 A' Plc RegS FRN 21/9/2067 | 90.703 | 0,03 |
| GBP 67.016 | CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 77.559 | 0,02 | EUR 325.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 298.422 | 0,09 |
| GBP 220.000 | CMF '2020-1 B' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 253.043 | 0,08 | GBP 45.539 | Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040 | 49.868 | 0,02 |
| GBP 100.000 | CMF '2020-1 C' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 114.666 | 0,04 | EUR 975.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,375% 18/1/2031 | 978.159 | 0,31 |
| GBP 150.100 | Economic Master Issuer '2023-1 A' Plc RegS FRN 25/6/2074 | 174.537 | 0,06 | GBP 100.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 112.390 | 0,04 |
| GBP 38.554 | Finsbury Square '2020-2X A' Plc RegS FRN 16/6/2070 | 44.721 | 0,01 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2020-1 C' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 116.054 | 0,04 |
| GBP 127.476 | Gemgarto '2021-1X A' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 146.882 | 0,05 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 114.134 | 0,04 |
| GBP 200.000 | Holmes Master Issuer '2023-1X A1' Plc RegS FRN 15/10/2072 | 232.794 | 0,07 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X B' Plc RegS FRN 20/12/2063 | 113.853 | 0,04 |
| GBP 99.994 | Hops Hill '1 B' Plc RegS FRN 27/5/2054 | 115.494 | 0,04 | GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2023-1 D' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 116.471 | 0,04 |
| GBP 148.000 | Hops Hill '3 C' Plc RegS FRN 21/12/2055 | 167.026 | 0,05 | GBP 191.000 | Tower Bridge Funding '2023-1X A' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 222.806 | 0,07 |
| EUR 300.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 24/9/2029 | 248.859 | 0,08 | GBP 100.000 | Twin Bridges '2018-1 B' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 115.966 | 0,04 |
| EUR 883.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 10/3/2032 | 894.037 | 0,29 | | | | |
| EUR 365.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 16/11/2032 | 376.790 | 0,12 | | | | |
| EUR 200.000 | Investec Bank Plc RegS FRN 17/2/2027 | 170.864 | 0,05 | | | | |
| GBP 170.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 B' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 197.131 | 0,06 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| GBP 100.000 | Twin Bridges '2018-1 D' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 115.990 | 0,04 | EUR 600.000 | Citigroup Inc RegS FRN 6/7/2026 | 564.756 | 0,18 |
| GBP 225.000 | Twin Bridges '2020-1 C' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 260.489 | 0,08 | EUR 600.000 | Citigroup Inc RegS FRN 24/7/2026 | 566.388 | 0,18 |
| GBP 136.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 152.319 | 0,05 | EUR 100.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 53.273 | 0,02 |
| GBP 263.000 | Twin Bridges '2022-1 B' Plc RegS FRN 11/12/2055 | 296.705 | 0,09 | EUR 425.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025 | 391.055 | 0,12 |
| GBP 100.000 | Twin Bridges '2023-1 C' RegS FRN 14/6/2055 | 115.763 | 0,04 | EUR 850.000 | Global Payments Inc 4,875% 17/3/2031 | 861.064 | 0,28 |
| GBP 1.990.000 | United Kingdom Gilt RegS 0,25% 31/1/2025* | 2.143.262 | 0,69 | EUR 1.400.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 1.159.396 | 0,37 |
| GBP 3.715.000 | United Kingdom Gilt RegS 0,125% 30/1/2026^ | 3.862.172 | 1,24 | EUR 825.000 | International Business Machines Corp 3,75% 6/2/2035 | 808.638 | 0,26 |
| GBP 3.360.000 | United Kingdom Gilt RegS 0,375% 22/10/2026^ | 3.405.344 | 1,09 | EUR 750.000 | Morgan Stanley FRN 26/7/2024 | 746.745 | 0,24 |
| GBP 1.212.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,125% 29/1/2027 | 1.387.741 | 0,44 | EUR 1.250.000 | Morgan Stanley FRN 2/3/2029 | 1.272.039 | 0,41 |
| GBP 90.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,50% 7/9/2034 | 106.839 | 0,03 | EUR 1.000.000 | Morgan Stanley FRN 25/1/2034^ | 1.049.490 | 0,34 |
| GBP 872.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/9/2039 | 987.371 | 0,32 | EUR 325.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0,993% 15/10/2026 | 236.057 | 0,08 |
| GBP 270.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2040 | 304.718 | 0,10 | EUR 625.000 | National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023^ | 621.712 | 0,20 |
| GBP 175.701 | United Kingdom Gilt RegS 3,25% 22/1/2044 | 169.056 | 0,05 | USD 141.847 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,125% 15/1/2033 | 128.701 | 0,04 |
| GBP 706.662 | United Kingdom Gilt RegS 3,50% 22/1/2045 | 703.230 | 0,22 | EUR 115.000 | US Bancorp 0,85% 7/6/2024 | 109.725 | 0,03 |
| GBP 945.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2046 | 1.050.692 | 0,34 | EUR 600.000 | Verizon Communications Inc 4,75% 31/10/2034 | 642.034 | 0,20 |
| GBP 570.000 | United Kingdom Gilt RegS 0,625% 22/10/2050^ | 262.932 | 0,08 | EUR 785.000 | Verizon Communications Inc 1,125% 19/9/2035 | 564.672 | 0,18 |
| GBP 2.830.000 | United Kingdom Gilt RegS 1,50% 31/7/2053 | 1.674.640 | 0,54 | | | 12.719.408 | 4,07 |
| GBP 1.000.000 | United Kingdom Gilt RegS 3,75% 22/10/2053 | 1.013.020 | 0,32 | | | 227.730.583 | 72,91 |
| GBP 697.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2055 | 778.074 | 0,25 | Gesamt Anleihen | | | |
| GBP 606.620 | United Kingdom Gilt RegS 4,00% 22/1/2060 | 649.366 | 0,21 | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| GBP 235.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,00% 22/10/2063 | 251.186 | 0,08 | Irland | | | |
| GBP 282.665 | United Kingdom Inflation-Linked Gilt RegS 0,125% 10/8/2028 | 320.768 | 0,10 | USD 5.000 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF^- | 207.820 | 0,07 |
| GBP 97.000 | United Kingdom Inflation-Linked Gilt RegS 0,625% 22/3/2045 | 101.605 | 0,03 | | | 207.820 | 0,07 |
| | | 37.983.323 | 12,16 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 207.820 | 0,07 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| EUR 150.000 | Air Products and Chemicals Inc 4,00% 3/3/2035 | 152.291 | 0,05 | | | 301.923.572 | 96,67 |
| EUR 195.000 | American Tower Corp 0,875% 21/5/2029 | 159.692 | 0,05 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 300.000 | American Tower Corp 4,625% 16/5/2031 | 300.971 | 0,10 | Irland | | | |
| EUR 125.000 | AT&T Inc 4,30% 18/11/2034 | 127.524 | 0,04 | 16.063 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)^- | 1.598.662 | 0,51 |
| EUR 113.000 | AT&T Inc 3,15% 4/9/2036 | 101.416 | 0,03 | | | 1.598.662 | 0,51 |
| USD 800.000 | Bank of America Corp FRN 25/4/2034 | 743.930 | 0,24 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 1.598.662 | 0,51 |
| EUR 200.000 | Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032 | 157.952 | 0,05 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 303.522.234 | 97,18 |
| EUR 300.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 267.409 | 0,09 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 8.818.544 | 2,82 |
| GBP 450.000 | BAT Capital Corp RegS 2,125% 15/8/2025 | 479.451 | 0,15 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 312.340.778 | 100,00 |
| EUR 300.000 | Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025 | 281.904 | 0,09 | | | | |
| USD 250.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,80% 1/3/2050 | 171.123 | 0,05 | | | | |

^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

^- Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Hungary | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|---|----------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | |
| Belgien | | | |
| (6.403) | KBC Group NV | Bank of America Merrill Lynch | 3.842 |
| | | | 3.842 |
| Frankreich | | | |
| (57.747) | Credit Agricole SA | Bank of America Merrill Lynch | 54.513 |
| (18.519) | Societe Generale SA | Bank of America Merrill Lynch | 37.585 |
| | | | 92.098 |
| Deutschland | | | |
| (52.249) | Deutsche Bank AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 12.331 |
| | | | 12.331 |
| Italien | | | |
| (42.940) | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Bank of America Merrill Lynch | (22.715) |
| | | | (22.715) |
| Norwegen | | | |
| (12.078) | DNB Bank ASA | Bank of America Merrill Lynch | (761) |
| | | | (761) |
| Schweden | | | |
| (20.086) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.990 |
| (109.358) | Svenska Handelsbanken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 12.105 |
| | | | 14.095 |
| Schweiz | | | |
| (46.938) | UBS Group AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (1.042) |
| | | | (1.042) |
| Großbritannien | | | |
| (786.162) | Lloyds Banking Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 17.994 |
| | | | 17.994 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – EUR 4.788.957) | | | 115.842 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|----------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | EUR 3.010.415 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (23.996) | (81.452) |
| CCCDs | EUR 16.006.512 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (75.698) | (54.370) |
| CCCDs | EUR 9.202.500 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (21.743) | (77.757) |
| CCCDs | EUR 6.157.715 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Subordinated Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (202.069) | 197.498 |
| CCILs | EUR 254.000 | Fund receives Fixed 2,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | (2.216) | (2.211) |
| CCILs | EUR 140.000 | Fund receives Fixed 2,415% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2032 | (4.524) | (4.521) |
| CCILs | EUR 1.130.000 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2032 | (13.164) | (13.140) |
| CCILs | EUR 1.040.000 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2032 | (12.115) | (12.094) |
| CCILs | EUR 273.000 | Fund receives Fixed 2,520% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 3/1/2038 | (4.286) | (2.950) |
| CCILs | EUR 254.000 | Fund receives Fixed 2,528% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 1.401 | 1.289 |
| CCILs | EUR 960.000 | Fund receives Fixed 2,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2032 | (18.715) | (18.695) |
| CCILs | EUR 20.000 | Fund receives Fixed 2,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2032 | (390) | (389) |
| CCILs | EUR 408.000 | Fund receives Fixed 2,574% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (462) | (451) |
| CCILs | EUR 1.128.000 | Fund receives Fixed 2,574% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (1.276) | (1.247) |
| CCILs | EUR 505.000 | Fund receives Fixed 2,601% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2043 | (4.554) | (4.191) |
| CCILs | EUR 1.045.000 | Fund receives Fixed 2,601% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2043 | (9.424) | (8.672) |
| CCILs | EUR 1.220.000 | Fund receives Fixed 2,654% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2024 | (1.587) | (1.580) |
| CCILs | EUR 520.000 | Fund receives Fixed 2,690% and pays Floating EUR 12 Month FRCPXTOB | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2033 | (12.434) | (12.342) |
| CCILs | GBP 93.000 | Fund receives Fixed 3,334% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2030 | (20.654) | (20.654) |
| CCILs | GBP 57.000 | Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2030 | (11.793) | (11.791) |
| CCILs | GBP 411.000 | Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2028 | (63.657) | (63.519) |
| CCILs | EUR 254.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,338% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2028 | 1.001 | 1.005 |
| CCILs | EUR 500.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,435% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 1.696 | 1.868 |
| CCILs | EUR 1.035.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,435% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 3.510 | 3.866 |
| CCILs | EUR 1.220.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,440% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2025 | 1.519 | 1.526 |
| CCILs | EUR 273.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,475% | Bank of America Merrill Lynch | 3/1/2028 | 467 | 335 |
| CCILs | EUR 254.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,528% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2028 | (1.185) | (1.314) |
| CCILs | EUR 45.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,555% | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2027 | 960 | 960 |
| CCILs | EUR 1.160.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,700% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2027 | 2.623 | 2.637 |
| CCILs | EUR 1.190.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,700% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2027 | 2.691 | 2.705 |
| CCILs | EUR 950.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,720% | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2027 | 12.571 | 12.582 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|--|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCILS | EUR 520.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month FRCPXTOB and pays Fixed 2,690% | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2028 | 7.465 | 7.371 |
| CCILS | GBP 87.122 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,750% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2052 | 3.491 | (315) |
| CCILS | GBP 434.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,340% | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2027 | (7.411) | (7.405) |
| CCIRS | EUR 741.000 | Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2032 | (120.697) | (120.536) |
| CCIRS | EUR 3.500.000 | Fund receives Fixed 1,370% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 12/4/2028 | (255.584) | (255.545) |
| CCIRS | EUR 270.000 | Fund receives Fixed 1,439% and pays Floating EUR 3 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | (66.359) | (66.455) |
| CCIRS | EUR 500.000 | Fund receives Fixed 1,566% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 29/4/2032 | (53.304) | (53.295) |
| CCIRS | EUR 235.000 | Fund receives Fixed 2,287% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2073 | 6.281 | 2.158 |
| CCIRS | EUR 1.160.000 | Fund receives Fixed 2,291% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 5/2/2028 | (4.919) | (4.911) |
| CCIRS | EUR 76.000 | Fund receives Fixed 2,400% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2073 | 3.339 | 3.145 |
| CCIRS | EUR 162.891 | Fund receives Fixed 2,408% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2048 | (7.393) | (7.387) |
| CCIRS | EUR 650.000 | Fund receives Fixed 2,410% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 30/3/2053 | (9.629) | (20.998) |
| CCIRS | EUR 133.000 | Fund receives Fixed 2,680% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 8/5/2033 | (513) | (840) |
| CCIRS | EUR 137.500 | Fund receives Fixed 2,690% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2033 | (547) | (714) |
| CCIRS | EUR 132.703 | Fund receives Fixed 2,701% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 20/3/2033 | (362) | (574) |
| CCIRS | EUR 1.770.000 | Fund receives Fixed 2,728% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/4/2033 | 4.204 | 5.193 |
| CCIRS | EUR 1.200.000 | Fund receives Fixed 2,733% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 18/4/2033 | 3.560 | 3.576 |
| CCIRS | EUR 600.000 | Fund receives Fixed 2,748% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2033 | 1.972 | 1.980 |
| CCIRS | EUR 365.000 | Fund receives Fixed 2,760% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 6/5/2043 | 312 | 320 |
| CCIRS | EUR 1.480.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2033 | 6.664 | 6.406 |
| CCIRS | EUR 365.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/5/2043 | 697 | 584 |
| CCIRS | EUR 230.000 | Fund receives Fixed 2,782% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 11/5/2043 | 537 | 543 |
| CCIRS | EUR 290.000 | Fund receives Fixed 2,824% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2033 | 1.834 | 1.837 |
| CCIRS | EUR 235.000 | Fund receives Fixed 2,832% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2043 | 1.357 | 1.362 |
| CCIRS | EUR 260.000 | Fund receives Fixed 2,839% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2033 | 1.877 | 1.881 |
| CCIRS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2033 | 1.793 | 1.711 |
| CCIRS | EUR 1.020.000 | Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2033 | 9.147 | 8.724 |
| CCIRS | EUR 76.964 | Fund receives Fixed 2,900% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/5/2043 | 500 | 549 |
| CCIRS | EUR 150.000 | Fund receives Fixed 2,989% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2043 | 3.043 | 3.047 |
| CCIRS | EUR 76.964 | Fund receives Fixed 3,000% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2043 | 1.549 | 1.674 |
| CCIRS | EUR 60.000 | Fund receives Fixed 3,000% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2043 | 1.344 | 1.319 |
| CCIRS | GBP 580.000 | Fund receives Fixed 4,056% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2028 | (12.361) | (12.352) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|-------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | GBP 1.330.000 | Fund receives Fixed 4,172% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 4/4/2025 | (23.449) | (24.494) |
| CCIRS | GBP 1.220.000 | Fund receives Fixed 4,190% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/4/2026 | (24.312) | (24.198) |
| CCIRS | GBP 350.000 | Fund receives Fixed 4,255% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2026 | (6.205) | (6.202) |
| CCIRS | GBP 60.000 | Fund receives Fixed 4,266% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2026 | (1.043) | (1.042) |
| CCIRS | GBP 3.020.000 | Fund receives Fixed 4,287% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 28/4/2026 | (50.826) | (50.809) |
| CCIRS | GBP 730.000 | Fund receives Fixed 4,298% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 28/4/2026 | (12.035) | (12.031) |
| CCIRS | GBP 715.000 | Fund receives Fixed 4,505% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/5/2025 | (7.775) | (8.367) |
| CCIRS | GBP 1.780.000 | Fund receives Fixed 4,505% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/5/2025 | (19.356) | (20.829) |
| CCIRS | GBP 1.520.000 | Fund receives Fixed 4,560% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2025 | (16.180) | (16.196) |
| CCIRS | GBP 2.120.000 | Fund receives Fixed 4,777% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2025 | (12.686) | (12.468) |
| CCIRS | GBP 365.000 | Fund receives Fixed 5,115% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2025 | 514 | 508 |
| CCIRS | GBP 365.000 | Fund receives Fixed 5,254% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2025 | 1.607 | 1.599 |
| CCIRS | EUR 640.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 2,875% | Bank of America Merrill Lynch | 4/5/2028 | (3.472) | (3.465) |
| CCIRS | EUR 600.351 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,010% | Bank of America Merrill Lynch | 20/3/2025 | 2.310 | 3.335 |
| CCIRS | EUR 600.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,060% | Bank of America Merrill Lynch | 8/5/2025 | 2.039 | 2.509 |
| CCIRS | EUR 618.750 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,140% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2025 | 2.189 | 2.084 |
| CCIRS | EUR 85.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,025% | Bank of America Merrill Lynch | 21/1/2061 | 49.547 | 49.551 |
| CCIRS | EUR 182.247 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533% | Bank of America Merrill Lynch | 4/12/2049 | 72.704 | 72.704 |
| CCIRS | EUR 264.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,797% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2052 | 95.040 | 94.603 |
| CCIRS | EUR 270.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,400% | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | 64.715 | 64.831 |
| CCIRS | EUR 90.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,089% | Bank of America Merrill Lynch | 23/1/2053 | 9.117 | 9.120 |
| CCIRS | EUR 565.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,193% | Bank of America Merrill Lynch | 4/10/2052 | 45.721 | 45.741 |
| CCIRS | EUR 322.127 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,270% | Bank of America Merrill Lynch | 4/3/2053 | 20.787 | 20.798 |
| CCIRS | EUR 80.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,360% | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2073 | (2.380) | (2.376) |
| CCIRS | EUR 650.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,410% | Bank of America Merrill Lynch | 30/3/2053 | 10.911 | 22.856 |
| CCIRS | EUR 310.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,668% | Bank of America Merrill Lynch | 4/2/2048 | 2.752 | 2.762 |
| CCIRS | EUR 339.750 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,669% | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2053 | (9.928) | (5.507) |
| CCIRS | EUR 163.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,723% | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2048 | (2.364) | (557) |
| CCIRS | EUR 500.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,727% | Bank of America Merrill Lynch | 4/11/2042 | 9.010 | 10.534 |
| CCIRS | EUR 300.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,727% | Bank of America Merrill Lynch | 4/11/2042 | 5.406 | 6.320 |
| CCIRS | EUR 110.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,730% | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2053 | (3.261) | (3.201) |
| CCIRS | EUR 266.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,912% | Bank of America Merrill Lynch | 22/6/2043 | (2.387) | (2.379) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-------------------|--|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 2.370.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,144% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2028 | (18.079) | (18.053) |
| CCIRS | EUR 2.240.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,186% | Bank of America Merrill Lynch | 13/4/2028 | (16.643) | (16.621) |
| CCIRS | USD 3.740.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,639% | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2026 | 23.021 | 23.048 |
| CCIRS | USD 910.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,652% | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2026 | 5.287 | 5.293 |
| CDS | EUR 128.000 | Fund receives default protection on Heidelberg Materials AG and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (436) | (21.384) |
| CDS | EUR 86.000 | Fund receives default protection on Holcim AG and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (473) | 452 |
| CDS | EUR 164.000 | Fund receives default protection on Holcim AG and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (786) | 863 |
| CDS | EUR 111.000 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 1.918 | 682 |
| CDS | EUR 51.090 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 557 | 314 |
| CDS | EUR 1.000.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Swiss Reinsurance Co Ltd | JP Morgan | 20/6/2028 | 4.469 | 17.677 |
| CDS | EUR 122.000 | Fund receives default protection on Heidelberg Materials AG and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (278) | (20.381) |
| CDS | EUR 250.000 | Fund receives default protection on Next Group Plc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (1.297) | 4.140 |
| IRS | KRW 4.642.338.750 | Fund receives Fixed 1,590% and pays Floating KRW 3 Month KWDCD | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (21.545) | (21.545) |
| IRS | KRW 3.868.590.000 | Fund receives Fixed 1,630% and pays Floating KRW 3 Month KWDCD | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (17.619) | (17.619) |
| IRS | KRW 3.868.641.250 | Fund receives Fixed 1,632% and pays Floating KRW 3 Month KWDCD | BNP Paribas | 21/9/2023 | (17.602) | (17.602) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 109.801.365) | | | | | (818.412) | (530.018) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILs: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 CDS: Credit Default Swaps
 IRS: Zinsraten-Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertrags- wahrung | Kontrakte/ Bezeichnung | Verfalls- datum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------------|--|--------------------|--|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (22) | USD | 3 Month SOFR Futures September 2023 | Dezember 2023 | 4.886.515 | 39.247 |
| (3) | EUR | DAX Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.183.950 | (39.450) |
| 221 | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 26.064.740 | 92.529 |
| (83) | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 9.789.020 | 20.758 |
| 91 | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 9.586.850 | 117.400 |
| 34 | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 3.931.760 | 59.635 |
| (11) | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.272.040 | (16.800) |
| 69 | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 9.363.990 | 45.654 |
| (84) | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 11.399.640 | 51.405 |
| 22 | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 3.029.400 | 66.720 |
| (174) | EUR | Euro Schatz Futures June 2023 | Juni 2023 | 18.368.310 | 32.869 |
| (41) | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.741.680 | (74.005) |
| 156 | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 773.760 | (14.580) |
| 29 | EUR | Euro-OAT Futures June 2023 | Juni 2023 | 3.776.090 | 34.370 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (3) | EUR | Euro-OAT Futures June 2023 | Juni 2023 | 390.630 | (2.740) |
| (8) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 7.943.277 | (35.480) |
| 10 | GBP | Three Month SONIA Index Futures December 2024 | März 2025 | 2.764.479 | (9.188) |
| 8 | GBP | Three Month SONIA Index Futures March 2024 | Juni 2024 | 2.196.627 | (11.217) |
| 22 | GBP | Three Month SONIA Index Futures September 2023 | Dezember 2023 | 6.036.899 | (58.587) |
| 1 | GBP | Three Month SONIA Index Futures September 2024 | Dezember 2024 | 275.883 | (2.203) |
| 133 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 14.875.098 | 198.386 |
| (2) | USD | US Long Bond Futures September 2023 | September 2023 | 239.756 | (3.280) |
| (31) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 3.492.581 | (18.806) |
| 7 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 750.132 | 5.691 |
| 20 | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 3.857.118 | 9.191 |
| (4) | USD | US Ultra Bond Futures September 2023 | September 2023 | 510.419 | (8.330) |
| Gesamt | | | | | 479.189 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|--|----------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 5.000.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2023; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 0,85 | 21/06/2023 | 3.886 | 11.616 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 2.775.000) | | | | | | 3.886 | 11.616 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|---|----------------|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (4.785.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed annually from 25/8/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 25/8/2024 | Citibank | GBP 4,75 | 25/08/2023 | (25.702) | (46.426) |
| (5.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2023; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 0,98 | 21/06/2023 | 4.599 | (1.801) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 4.147.215) | | | | | | (21.103) | (48.227) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Select Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 275.000 | EUR | 258.680 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (1.416) |
| USD | 120.000 | EUR | 111.418 | Bank of America Merrill Lynch | 18/7/2023 | 665 |
| USD | 189.000 | EUR | 173.183 | Deutsche Bank | 18/7/2023 | 3.349 |
| USD | 178.000 | EUR | 161.784 | HSBC | 18/7/2023 | 4.473 |
| USD | 325.571 | GBP | 260.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 3.353 |
| USD | 624.248 | JPY | 87.000.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 1.627 |
| USD | 671.444 | NOK | 6.900.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 49.040 |
| USD | 956.161 | NOK | 10.000.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 55.219 |
| USD | 626.647 | NZD | 1.000.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 25.262 |
| USD | 626.824 | NZD | 1.000.000 | Citibank | 21/6/2023 | 25.428 |
| USD | 638.217 | NZD | 1.040.000 | HSBC | 21/6/2023 | 13.647 |
| USD | 970.794 | NZD | 1.550.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 38.681 |
| | | | | | | (1.423.809) |
| Auf CZK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CZK | 30.689.943 | EUR | 1.306.037 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (16.157) |
| EUR | 34.389 | CZK | 817.116 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 46 |
| | | | | | | (16.111) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 5 | USD | 5 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| USD | 175 | EUR | 159 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 5 |
| | | | | | | 5 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 292.661.149) | | | | | | (1.439.915) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Finanzen | 34,54 |
| Staatsanleihen | 29,71 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 9,57 |
| Industrie | 5,04 |
| Versorger | 5,01 |
| Energie | 2,58 |
| Zyklische Konsumgüter | 2,34 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 2,31 |
| Kommunikation | 2,12 |
| Technologie | 1,73 |
| Grundstoffe | 0,89 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 0,76 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 0,51 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 0,07 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 97,18 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 2,82 |
| <hr/> | |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock European Unconstrained Equity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Großbritannien | | | |
| | | | | 269.667 | Auto Trader Group Plc | 1.979.633 | 3,43 |
| | | | | 37.942 | London Stock Exchange Group Plc | 3.759.231 | 6,52 |
| | | | | 49.069 | RELX Plc | 1.443.826 | 2,50 |
| | | | | 19.805 | Spirax-Sarco Engineering Plc | 2.517.673 | 4,36 |
| | | | | | | 9.700.363 | 16,81 |
| STAMMAKTIEN | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| Dänemark | | | | 6.910 | Cadence Design Systems Inc | 1.510.008 | 2,61 |
| 36.241 | Novo Nordisk A/S 'B' | 5.439.200 | 9,42 | 6.778 | Mastercard Inc 'A' | 2.285.064 | 3,96 |
| | | 5.439.200 | 9,42 | 9.147 | Microsoft Corp | 2.868.102 | 4,97 |
| Frankreich | | | | 6.062 | S&P Global Inc | 2.054.409 | 3,56 |
| 1.732 | Hermes International | 3.311.931 | 5,74 | | | 8.717.583 | 15,10 |
| 6.454 | L'Oreal SA | 2.579.018 | 4,47 | Gesamt Stammaktien | | | |
| 5.662 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 4.612.832 | 7,99 | | | 57.844.570 | 100,21 |
| 4.552 | Sartorius Stedim Biotech | 1.116.150 | 1,93 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| | | 11.619.931 | 20,13 | | | 57.844.570 | 100,21 |
| Deutschland | | | | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| 2.143 | Rational AG | 1.339.375 | 2,32 | Irland | | | |
| 18.305 | Symrise AG | 1.848.805 | 3,20 | 1.071 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) [*] | 106.600 | 0,19 |
| | | 3.188.180 | 5,52 | | | 106.600 | 0,19 |
| Irland | | | | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| 25.107 | Kingspan Group Plc (traded in Ireland) | 1.586.260 | 2,75 | | | 106.600 | 0,19 |
| | | 1.586.260 | 2,75 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| Niederlande | | | | | | | |
| 8.364 | ASML Holding NV [*] | 5.661.592 | 9,81 | Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | | |
| 10.622 | Ferrari NV | 2.854.131 | 4,94 | | | (229.670) | (0,40) |
| | | 8.515.723 | 14,75 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | |
| Schweden | | | | | | 57.721.500 | 100,00 |
| 87.976 | Assa Abloy AB 'B' | 1.841.241 | 3,19 | | | | |
| 202.119 | Hexagon AB 'B' | 2.218.684 | 3,85 | | | | |
| | | 4.059.925 | 7,04 | | | | |
| Schweiz | | | | | | | |
| 4.119 | Lonza Group AG Reg | 2.408.466 | 4,17 | | | | |
| 23.333 | Nestlé SA Reg [*] | 2.608.939 | 4,52 | | | | |
| | | 5.017.405 | 8,69 | | | | |

^{*} Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

^{*} Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|-----------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 100.252 | GBP | 87.174 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (767) |
| GBP | 2.405.199 | EUR | 2.755.599 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 31.552 |
| | | | | | | 30.785 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 349 | USD | 379 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (5) |
| USD | 8.232 | EUR | 7.445 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 258 |
| | | | | | | 253 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 2.896.227) | | | | | | 31.038 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 30,57 |
| Zyklische Konsumgüter | 20,99 |
| Technologie | 17,39 |
| Industrie | 14,15 |
| Finanzen | 10,48 |
| Kommunikation | 3,43 |
| Grundstoffe | 3,20 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 0,19 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 100,40 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (0,40) |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| ANLEIHEN | | | | Kaimaninseln Fortsetzung | | | |
| | Argentinien | | | USD 250.000 | Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd '2017-26A BR' FRN 18/10/2030 | 229.387 | 0,24 |
| USD 14.000 | YPF SA 7,00% 15/12/2047 | 8.478 | 0,01 | USD 250.000 | Regatta VIII Funding Ltd '2017-1A D' FRN 17/10/2030 | 224.282 | 0,24 |
| USD 13.307 | YPF SA RegS 7,00% 30/9/2033 | 8.335 | 0,01 | USD 250.000 | RR 19 Ltd '2021-19 A2' FRN 15/10/2035 | 230.537 | 0,24 |
| | | 16.813 | 0,02 | USD 200.000 | Shui On Development Holding Ltd RegS 5,75% 12/11/2023 | 179.146 | 0,19 |
| | Australien | | | USD 200.000 | Sunac China Holdings Ltd RegS 7,25% 14/6/2023 | 28.565 | 0,03 |
| EUR 300.000 | Origin Energy Finance Ltd RegS 1,00% 17/9/2029 | 276.855 | 0,29 | USD 200.000 | Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 8,50% 4/2/2024 | 9.834 | 0,01 |
| EUR 100.000 | Telstra Group Ltd RegS 3,75% 4/5/2031 | 101.316 | 0,11 | | | 2.640.643 | 2,77 |
| EUR 100.000 | Transurban Finance Co Pty Ltd RegS 4,225% 26/4/2033 | 101.217 | 0,10 | Kolumbien | | | |
| | | 479.388 | 0,50 | COP 359.000.000 | Colombian TES 7,50% 26/8/2026 | 70.185 | 0,07 |
| | Österreich | | | COP 221.000.000 | Colombian TES 5,75% 3/11/2027 | 39.160 | 0,04 |
| EUR 100.000 | Lenzing AG RegS FRN 31/12/2099 | 83.375 | 0,09 | COP 75.000.000 | Colombian TES 7,00% 26/3/2031 | 12.753 | 0,01 |
| | | 83.375 | 0,09 | COP 130.000.000 | Colombian TES 7,25% 18/10/2034 | 20.958 | 0,02 |
| | Belgien | | | USD 7.000 | Ecopetrol SA 5,875% 18/9/2023 | 6.554 | 0,01 |
| GBP 100.000 | Anheuser-Busch InBev SA RegS 9,75% 30/7/2024 | 121.243 | 0,13 | USD 51.000 | Ecopetrol SA 4,125% 16/1/2025 | 45.854 | 0,05 |
| EUR 200.000 | KBC Group NV RegS FRN 19/4/2030 | 200.246 | 0,21 | USD 90.000 | Ecopetrol SA 6,875% 29/4/2030 | 75.239 | 0,08 |
| EUR 100.000 | Lonza Finance International NV RegS 3,875% 25/5/2033 | 100.845 | 0,10 | | | 270.703 | 0,28 |
| | | 422.334 | 0,44 | Tschechische Republik | | | |
| | Britische Jungferninseln | | | CZK 910.000 | Czech Republic Government Bond 5,00% 30/9/2030 | 39.306 | 0,04 |
| USD 200.000 | Peak RE Bvi Holding Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 150.859 | 0,16 | CZK 300.000 | Czech Republic Government Bond RegS 0,95% 15/5/2030 | 9.947 | 0,01 |
| USD 162.160 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd RegS 6,75% 24/4/2033 | 148.796 | 0,15 | CZK 310.000 | Czech Republic Government Bond RegS 4,20% 4/12/2036 | 12.621 | 0,01 |
| | | 299.655 | 0,31 | | | 61.874 | 0,06 |
| | Kanada | | | Dänemark | | | |
| USD 120.000 | Rogers Communications Inc 4,55% 15/3/2052 | 89.095 | 0,09 | EUR 100.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 17/2/2027 | 91.824 | 0,10 |
| | | 89.095 | 0,09 | GBP 250.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 13/4/2027 | 279.251 | 0,29 |
| | Kaimaninseln | | | | | 371.075 | 0,39 |
| USD 250.000 | ACAS CLO '2015-1A CRR' Ltd FRN 18/10/2028 | 224.964 | 0,24 | Frankreich | | | |
| USD 250.000 | Bain Capital Credit CLO '2021-3A D' Ltd FRN 24/7/2034 | 204.242 | 0,21 | EUR 65.700 | Air France-KLM RegS 0,125% 25/3/2026 | 11.264 | 0,01 |
| USD 250.000 | CIFC Funding '2017-4A A2R' Ltd FRN 24/10/2030 | 229.011 | 0,24 | EUR 100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 4,00% 21/11/2029 | 101.062 | 0,11 |
| USD 200.000 | CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 6,45% 7/11/2024 | 19.199 | 0,02 | GBP 250.000 | BNP Paribas SA RegS 3,375% 23/1/2026 | 271.361 | 0,28 |
| USD 416.179 | Deer Creek CLO '2017-1 A' Ltd FRN 20/10/2030 | 385.936 | 0,41 | EUR 250.000 | BNP Paribas SA RegS 2,75% 27/1/2026 | 241.788 | 0,25 |
| USD 200.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 15,00% 18/12/2023 | 15.908 | 0,02 | EUR 100.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 23/2/2029 | 99.751 | 0,10 |
| USD 200.000 | Gaci First Investment Co RegS 5,00% 13/10/2027 | 188.020 | 0,20 | EUR 100.000 | BNP Paribas SA RegS 1,375% 28/5/2029 | 84.999 | 0,09 |
| USD 200.000 | Kaisa Group Holdings Ltd 11,95% 22/10/2023 | 13.112 | 0,01 | GBP 100.000 | BNP Paribas SA RegS 5,75% 13/6/2032 | 112.843 | 0,12 |
| USD 250.000 | Madison Park Funding '2014-13A BR2' Ltd FRN 19/4/2030 | 231.386 | 0,24 | EUR 100.000 | BPCE SA RegS 4,00% 29/11/2032 | 99.957 | 0,10 |
| USD 250.000 | Marble Point CLO 2020-1A D' Ltd FRN 20/4/2033 | 213.875 | 0,22 | EUR 100.000 | BPCE SA RegS FRN 25/1/2035 | 98.186 | 0,10 |
| USD 239.633 | Modern Land China Co Ltd RegS 9,00% 30/12/2026 | 13.239 | 0,01 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| EUR 200.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 142.770 | 0,15 | EUR 100.000 | HT Troplast GmbH RegS 9,25% 15/7/2025 | 99.412 | 0,10 |
| GBP 400.000 | Credit Agricole SA 7,375% 18/12/2023 | 466.120 | 0,49 | EUR 100.000 | LANXESS AG RegS FRN 6/12/2076 | 99.947 | 0,11 |
| GBP 100.000 | Electricite de France SA RegS 6,25% 30/5/2028 | 116.426 | 0,12 | EUR 300.000 | Robert Bosch GmbH RegS 4,375% 2/6/2043 | 309.147 | 0,32 |
| EUR 100.000 | Electricite de France SA RegS 4,25% 25/1/2032 | 99.970 | 0,10 | EUR 131.000 | Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,625% 19/7/2029 | 106.519 | 0,11 |
| GBP 300.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 313.432 | 0,33 | EUR 100.000 | ZF Finance GmbH RegS 5,75% 3/8/2026 | 100.678 | 0,11 |
| EUR 100.000 | Engie SA RegS FRN 31/12/2099 | 97.284 | 0,10 | | | 3.306.476 | 3,46 |
| EUR 500.000 | Harmony French Home Loans FCT '2020-2 B' RegS FRN 27/8/2061 | 495.329 | 0,52 | Hongkong | | | |
| EUR 300.000 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 B' RegS FRN 27/5/2061 | 293.124 | 0,31 | USD 250.000 | Bank of East Asia Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 200.156 | 0,21 |
| EUR 100.000 | Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement RegS 0,625% 16/9/2028 | 82.256 | 0,09 | USD 65.000 | Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd FRN (Perpetual) | 60.433 | 0,06 |
| GBP 100.000 | Korian SA RegS FRN 31/12/2099 | 92.867 | 0,10 | | | 260.589 | 0,27 |
| EUR 100.000 | La Financiere Atalian SASU RegS 5,125% 15/5/2025 | 69.791 | 0,07 | Indien | | | |
| EUR 100.000 | Nexans SA RegS 5,50% 5/4/2028 | 102.196 | 0,11 | USD 200.000 | Power Finance Corp Ltd RegS 4,50% 18/6/2029 | 176.829 | 0,19 |
| EUR 100.000 | RCI Banque SA RegS FRN 18/2/2030 | 92.285 | 0,10 | | | 176.829 | 0,19 |
| EUR 100.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 95.129 | 0,10 | Indonesien | | | |
| EUR 100.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 96.534 | 0,10 | IDR 452.000.000 | Indonesia Treasury Bond 6,375% 15/8/2028 | 28.706 | 0,03 |
| EUR 100.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE RegS FRN 31/12/2099 | 87.587 | 0,09 | IDR 214.000.000 | Indonesia Treasury Bond 9,00% 15/3/2029 | 15.182 | 0,02 |
| EUR 100.000 | WPP Finance SA RegS 4,125% 30/5/2028 | 100.833 | 0,11 | IDR 328.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029 | 22.573 | 0,02 |
| | | 3.965.144 | 4,15 | IDR 4.520.000.000 | Indonesia Treasury Bond 6,375% 15/4/2032 | 282.119 | 0,30 |
| Deutschland | | | | IDR 4.127.000.000 | Indonesia Treasury Bond 7,00% 15/2/2033 | 269.451 | 0,28 |
| EUR 300.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2049 | 300.195 | 0,31 | IDR 543.000.000 | Indonesia Treasury Bond 7,50% 15/5/2038 | 36.589 | 0,04 |
| EUR 200.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 | 136.490 | 0,14 | USD 200.000 | Sarana Multi Infrastruktur Persero PT RegS 2,05% 11/5/2026 | 167.399 | 0,17 |
| EUR 70.000 | Bayer AG RegS 4,00% 26/8/2026 | 70.549 | 0,07 | | | 822.019 | 0,86 |
| EUR 26.000 | Bayer AG RegS FRN 1/7/2074 | 25.268 | 0,03 | Irland | | | |
| EUR 400.000 | Bayer AG RegS FRN 12/11/2079 | 372.620 | 0,39 | EUR 100.000 | Aurium CLO '2X ERR' DAC RegS FRN 22/6/2034 | 88.899 | 0,09 |
| GBP 100.000 | Commerzbank AG RegS FRN 28/2/2033 | 114.179 | 0,12 | EUR 99.854 | Aurium CLO '4X AR' DAC RegS FRN 16/1/2031 | 97.906 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS FRN 31/12/2099 | 92.062 | 0,10 | EUR 100.000 | Aurium Clo '8X A' DAC RegS FRN 23/6/2034 | 96.754 | 0,10 |
| GBP 500.000 | Deutsche Bank AG RegS 2,625% 16/12/2024 | 542.531 | 0,57 | EUR 150.000 | Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 5/6/2026 | 142.327 | 0,15 |
| GBP 300.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 12/12/2030 | 327.685 | 0,34 | EUR 100.000 | BBAM European CLO '1X ER' DAC RegS FRN 22/7/2034 | 89.319 | 0,09 |
| EUR 100.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 19/5/2031 | 97.288 | 0,10 | EUR 100.000 | Bridgepoint CLO '4X A' DAC RegS FRN 20/1/2037 | 100.179 | 0,11 |
| EUR 100.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 89.048 | 0,09 | EUR 100.000 | CIFC European Funding CLO '4X A' DAC RegS FRN 18/8/2035 | 97.042 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Deutsche Lufthansa AG RegS 3,50% 14/7/2029 | 90.523 | 0,10 | EUR 100.000 | Contego CLO '6X AR' DAC RegS FRN 15/4/2034 | 96.995 | 0,10 |
| EUR 100.000 | E.ON SE 3,50% 26/10/2037 | 93.861 | 0,10 | EUR 556.839 | Haus European Loan Conduit '39X A1' DAC RegS FRN 28/7/2051 | 523.429 | 0,55 |
| EUR 200.000 | EnBW Energie Baden- Wuerttemberg AG RegS FRN 31/8/2081 | 141.748 | 0,15 | EUR 100.000 | Kerry Group Financial Services Unltd Co RegS 2,375% 10/9/2025 | 98.421 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Heidelberg Materials AG RegS 3,75% 31/5/2032 | 96.726 | 0,10 | EUR 140.000 | Palmer Square European CLO '2023-1X A' DAC RegS FRN 15/7/2036 | 140.133 | 0,15 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------|---|------------------------|--------------------|---------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Irland Fortsetzung | | | | Jersey Fortsetzung | | | |
| EUR 100.000 | Palmer Square European CLO '2023-1X D' DAC RegS FRN 15/7/2036 | 100.000 | 0,11 | GBP 400.000 | Heathrow Funding Ltd RegS 7,125% 14/2/2024 | 466.394 | 0,49 |
| EUR 736.362 | Pearl Finance '2020-1 A1' DAC RegS FRN 17/11/2032 | 721.634 | 0,76 | | | 664.158 | 0,70 |
| EUR 200.000 | Ryanair DAC RegS 2,875% 15/9/2025 | 195.850 | 0,21 | Kuwait | | | |
| EUR 405.919 | SCF Rahoituspalvelut IX DAC 'B' RegS FRN 25/10/2030 | 403.476 | 0,42 | USD 200.000 | Burgan Bank SAK RegS FRN 15/12/2031 | 143.572 | 0,15 |
| GBP 189.959 | Taurus '2019-UK2 C' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 213.064 | 0,22 | | | 143.572 | 0,15 |
| GBP 124.089 | Taurus '2021-UK1X A' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 138.676 | 0,15 | Luxemburg | | | |
| EUR 100.000 | Tikehau CLO '7X A' DAC RegS FRN 20/10/2035 | 99.621 | 0,10 | EUR 250.000 | ArcelorMittal SA RegS 4,875% 26/9/2026 | 255.375 | 0,27 |
| | | 3.443.725 | 3,61 | GBP 100.000 | Aroundtown SA RegS FRN 31/12/2099 | 39.043 | 0,04 |
| Italien | | | | USD 7.000 | Atento Luxco 1 SA 8,00% 10/2/2026 | 1.164 | 0,00 |
| EUR 400.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028 | 354.556 | 0,37 | USD 5.000 | Atento Luxco 1 SA RegS 8,00% 10/2/2026 | 832 | 0,00 |
| EUR 249.857 | Autoflorence '2 B' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 245.529 | 0,26 | EUR 100.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1,336% 13/8/2041 | 63.489 | 0,07 |
| EUR 100.000 | Azzurra Aeroporti SpA RegS 2,125% 30/5/2024 | 96.993 | 0,10 | EUR 100.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl RegS 8,50% 15/7/2031 | 99.824 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS FRN 2/3/2026 | 99.973 | 0,10 | EUR 100.000 | European TopSoho Sarl RegS 4,00% 21/9/2023 | 82.490 | 0,09 |
| EUR 100.000 | Centurion Bidco SpA RegS 11,125% 15/5/2028 | 101.452 | 0,11 | USD 20.000 | Gol Finance SA 7,00% 31/1/2025 | 8.717 | 0,01 |
| USD 200.000 | Enel SpA FRN 24/9/2073 | 187.085 | 0,20 | EUR 100.000 | Herens Midco Sarl RegS 5,25% 15/5/2029 | 63.203 | 0,07 |
| EUR 100.000 | Eni SpA RegS 4,25% 19/5/2033 | 100.935 | 0,11 | EUR 100.000 | Rossini Sarl RegS 6,75% 30/10/2025 | 101.006 | 0,10 |
| EUR 250.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 232.093 | 0,24 | EUR 271.807 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 B' RegS FRN 14/11/2034 | 269.591 | 0,28 |
| EUR 100.000 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA RegS 1,625% 21/10/2028 | 88.798 | 0,09 | EUR 300.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 247.470 | 0,26 |
| GBP 100.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 5,148% 10/6/2030 | 95.192 | 0,10 | | | 1.232.204 | 1,29 |
| EUR 296.245 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,40% 15/5/2039 | 306.643 | 0,32 | Mauritius | | | |
| EUR 100.000 | Lottomatica SpA/Roma RegS FRN 1/6/2028 | 99.679 | 0,10 | USD 186.000 | Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd RegS 4,25% 25/3/2027 | 151.072 | 0,16 |
| EUR 155.221 | Progetto Quinto '1 A' Srl RegS FRN 27/10/2036 | 154.372 | 0,16 | USD 200.000 | Network i2i Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 181.369 | 0,19 |
| EUR 100.000 | Rekeep SpA RegS 7,25% 1/2/2026 | 90.970 | 0,10 | | | 332.441 | 0,35 |
| EUR 100.000 | Telecom Italia SpA RegS 6,875% 15/2/2028 | 100.425 | 0,11 | Mexiko | | | |
| EUR 200.000 | UniCredit SpA RegS FRN 16/2/2029 | 194.512 | 0,20 | USD 17.469 | Grupo Posadas SAB de CV RegS 5,00% 30/12/2027 | 14.091 | 0,01 |
| | | 2.549.207 | 2,67 | USD 200.000 | Metalsa Sapi De Cv RegS 3,75% 4/5/2031 | 142.828 | 0,15 |
| Japan | | | | MXN 1.300.000 | Mexican Bonos 7,50% 3/6/2027 | 65.122 | 0,07 |
| GBP 300.000 | Development Bank of Japan Inc RegS 1,25% 31/1/2025 | 324.861 | 0,34 | MXN 4.550.000 | Mexican Bonos 8,50% 31/5/2029 | 237.451 | 0,25 |
| EUR 100.000 | East Japan Railway Co RegS 2,614% 8/9/2025 | 98.179 | 0,10 | MXN 1.695.600 | Mexican Bonos 8,50% 18/11/2038 | 86.157 | 0,09 |
| GBP 150.000 | Mizuho Financial Group Inc RegS 5,628% 13/6/2028 | 170.290 | 0,18 | MXN 45.600.000 | Mexico Cetes 28/11/2024 (Zero Coupon) | 205.479 | 0,21 |
| EUR 600.000 | Nissan Motor Co Ltd RegS 2,652% 17/3/2026 | 565.860 | 0,59 | MXN 16.728.000 | Mexico Cetes 23/1/2025 (Zero Coupon) | 74.729 | 0,08 |
| EUR 100.000 | SoftBank Group Corp RegS 3,125% 19/9/2025 | 93.905 | 0,10 | MXN 501.300 | Petroleos Mexicanos 7,19% 12/9/2024 | 24.772 | 0,03 |
| | | 1.253.095 | 1,31 | USD 96.000 | Petroleos Mexicanos 6,875% 4/8/2026 | 82.358 | 0,09 |
| Jersey | | | | USD 36.000 | Petroleos Mexicanos 8,75% 2/6/2029* | 29.990 | 0,03 |
| GBP 100.000 | Galaxy Bidco Ltd RegS 6,50% 31/7/2026 | 105.588 | 0,11 | USD 29.000 | Petroleos Mexicanos 6,70% 16/2/2032 | 20.336 | 0,02 |
| EUR 100.000 | Glencore Finance Europe Ltd RegS 1,50% 15/10/2026 | 92.176 | 0,10 | USD 24.000 | Petroleos Mexicanos 6,35% 12/2/2048 | 13.087 | 0,01 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Mexiko Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| EUR 1.670.000 | Petroleos Mexicanos RegS 3,75% 21/2/2024 | 1.640.328 | 1,72 | EUR 100.000 | Universal Music Group NV RegS 3,00% 30/6/2027 | 97.089 | 0,10 |
| | | 2.636.728 | 2,76 | EUR 120.000 | Viterra Finance BV RegS 0,375% 24/9/2025 | 109.142 | 0,11 |
| Niederlande | | | | EUR 200.000 | Viterra Finance BV RegS 1,00% 24/9/2028 | 165.690 | 0,17 |
| GBP 300.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 5,25% 26/5/2026 | 343.344 | 0,36 | GBP 100.000 | Volkswagen Financial Services NV RegS 2,125% 27/6/2024 | 111.393 | 0,12 |
| EUR 200.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,375% 20/10/2028 | 199.990 | 0,21 | EUR 100.000 | Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual) | 96.647 | 0,10 |
| EUR 300.000 | Aegon NV RegS FRN 25/4/2044 | 293.787 | 0,31 | EUR 200.000 | Wintershall Dea Finance 2 BV RegS FRN 31/12/2099 | 170.334 | 0,18 |
| EUR 300.000 | AGCO International Holdings BV RegS 0,80% 6/10/2028 | 253.299 | 0,27 | EUR 100.000 | Wintershall Dea Finance BV RegS 0,84% 25/9/2025 | 92.754 | 0,10 |
| EUR 200.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 187.910 | 0,20 | EUR 100.000 | Wintershall Dea Finance BV RegS 1,332% 25/9/2028 | 84.973 | 0,09 |
| GBP 76.000 | Deutsche Telekom International Finance BV 8,875% 27/11/2028 | 102.167 | 0,11 | EUR 100.000 | Wolters Kluwer NV RegS 0,75% 3/7/2030 | 82.881 | 0,09 |
| EUR 272.234 | Domi '2021-1 A' BV RegS FRN 15/6/2053 | 270.283 | 0,28 | | | 6.364.918 | 6,67 |
| EUR 351.123 | Dutch Property Finance '2021-1 A' BV RegS FRN 28/7/2058 | 349.557 | 0,37 | Norwegen | | | |
| EUR 412.679 | Dutch Property Finance '2023-1 A' BV RegS FRN 28/4/2064 | 412.875 | 0,43 | EUR 100.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 21/9/2027 | 97.985 | 0,10 |
| EUR 70.000 | EnBW International Finance BV RegS 4,00% 24/1/2035 | 69.073 | 0,07 | | | 97.985 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Ferrovial Netherlands BV RegS FRN 31/12/2099 | 97.517 | 0,10 | Philippinen | | | |
| USD 188.000 | Greenko Dutch BV RegS 3,85% 29/3/2026 | 155.929 | 0,16 | USD 200.000 | Rizal Commercial Banking Corp RegS FRN 31/12/2099 | 166.897 | 0,18 |
| EUR 100.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 97.230 | 0,10 | | | 166.897 | 0,18 |
| EUR 170.000 | IMCD NV RegS 2,125% 31/3/2027 | 155.252 | 0,16 | Polen | | | |
| EUR 100.000 | ING Groep NV RegS FRN 23/5/2026 | 95.886 | 0,10 | USD 80.000 | Republic of Poland Government International Bond 4,875% 4/10/2033 | 74.807 | 0,08 |
| EUR 100.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2027 | 92.142 | 0,10 | | | 74.807 | 0,08 |
| EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 26/9/2029 | 189.398 | 0,20 | Portugal | | | |
| GBP 100.000 | ING Groep NV RegS FRN 20/5/2033 | 110.510 | 0,12 | EUR 157.540 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance '1 B' RegS FRN 28/10/2040 | 150.878 | 0,16 |
| EUR 157.359 | Jubilee Place '2020-1 A' BV RegS FRN 17/10/2057 | 157.616 | 0,16 | | | 150.878 | 0,16 |
| EUR 215.000 | Jubilee Place '3 B' RegS FRN 17/1/2059 | 208.797 | 0,22 | Rumänien | | | |
| EUR 100.000 | Prosus NV RegS 1,288% 13/7/2029 | 75.720 | 0,08 | EUR 100.000 | RCS & RDS SA RegS 2,50% 5/2/2025 | 95.181 | 0,10 |
| EUR 150.000 | Prosus NV RegS 2,778% 19/1/2034 | 109.545 | 0,11 | EUR 32.000 | Romanian Government International Bond RegS 2,125% 7/3/2028 | 27.598 | 0,03 |
| EUR 100.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 87.444 | 0,09 | | | 122.779 | 0,13 |
| EUR 100.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 90.272 | 0,09 | Russland | | | |
| EUR 247.000 | Sagax Euro Mtn NL BV RegS 1,00% 17/5/2029* | 173.505 | 0,18 | RUB 3.001.000 | Russian Federal Bond - OFZ 6,10% 18/7/2035 | 2.077 | 0,00 |
| EUR 118.442 | Summer BidCo BV RegS 9,00% 15/11/2025 | 103.636 | 0,11 | | | 2.077 | 0,00 |
| EUR 100.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 78.536 | 0,08 | Saudi-Arabien | | | |
| EUR 200.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 197.864 | 0,21 | EUR 1.300.000 | Saudi Government International Bond RegS 3/3/2024 (Zero Coupon) | 1.259.005 | 1,32 |
| EUR 400.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 391.220 | 0,41 | | | 1.259.005 | 1,32 |
| EUR 100.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7,375% 15/9/2029 | 101.302 | 0,11 | Singapur | | | |
| EUR 100.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7,875% 15/9/2031 | 102.409 | 0,11 | USD 115.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 4,75% 19/5/2033 | 107.624 | 0,11 |
| | | | | USD 205.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,30% 19/5/2053 | 195.766 | 0,21 |
| | | | | USD 111.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,34% 19/5/2063 | 103.364 | 0,11 |
| | | | | | | 406.754 | 0,43 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|-------------|---|------------------------|--------------------|
| ZAR 1.833.000 | Südafrika Republic of South Africa Government Bond 8,00% 31/1/2030 | 73.983 | 0,08 | USD 200.000 | Thailand Kasikornbank PCL RegS FRN 31/12/2099 | 174.785 | 0,18 |
| | | 73.983 | 0,08 | | | 174.785 | 0,18 |
| USD 200.000 | Südkorea Tongyang Life Insurance Co Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 163.289 | 0,17 | EUR 100.000 | Großbritannien Anglo American Capital Plc RegS 5,00% 15/3/2031 | 102.996 | 0,11 |
| | | 163.289 | 0,17 | EUR 100.000 | Anglo American Capital Plc RegS 4,75% 21/9/2032 | 100.330 | 0,11 |
| EUR 281.278 | Spanien Autonoria Spain '2021-SP B' FT RegS FRN 31/1/2039 | 278.063 | 0,29 | GBP 210.164 | Atlas Funding '2021-1 A' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 243.612 | 0,26 |
| EUR 100.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS FRN 16/1/2030 | 92.459 | 0,10 | USD 17.532 | Avianca Midco 2 Plc 9,00% 1/12/2028 | 13.822 | 0,01 |
| EUR 500.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 22/7/2025 | 465.610 | 0,49 | EUR 100.000 | Barclays Plc RegS FRN 9/8/2029 | 80.711 | 0,08 |
| EUR 100.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 7/2/2029 | 96.824 | 0,10 | GBP 150.000 | Barclays Plc RegS FRN 22/11/2030 | 158.358 | 0,17 |
| EUR 100.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 16/8/2033 | 90.724 | 0,09 | GBP 155.000 | Barclays Plc RegS FRN 31/1/2031 | 176.918 | 0,19 |
| GBP 100.000 | Banco Santander SA RegS 1,50% 14/4/2026 | 101.387 | 0,11 | EUR 300.000 | Barclays Plc RegS FRN 22/3/2031 | 262.251 | 0,27 |
| GBP 400.000 | Banco Santander SA RegS FRN 6/10/2026 | 427.069 | 0,45 | EUR 100.000 | Barclays Plc RegS FRN 29/1/2034 | 101.343 | 0,11 |
| EUR 100.000 | Banco Santander SA RegS 3,875% 16/1/2028 | 99.538 | 0,10 | EUR 100.000 | BAT International Finance Plc RegS 1,25% 13/3/2027 | 90.305 | 0,09 |
| GBP 100.000 | Banco Santander SA RegS FRN 30/8/2028 | 110.049 | 0,12 | EUR 200.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual) | 185.434 | 0,19 |
| EUR 100.000 | Bankinter SA RegS FRN 3/5/2030 | 100.171 | 0,10 | EUR 125.000 | Brambles Finance Plc RegS 4,25% 22/3/2031 | 126.689 | 0,13 |
| EUR 100.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033 | 78.768 | 0,08 | GBP 403.320 | Brants Bridge '2022-1 A' Plc RegS FRN 12/12/2064 | 467.801 | 0,49 |
| GBP 150.000 | Telefonica Emisiones SA RegS 5,375% 2/2/2026 | 171.886 | 0,18 | GBP 308.182 | Brass '11X A1' Plc RegS FRN 16/11/2070 | 360.261 | 0,38 |
| | | 2.112.548 | 2,21 | GBP 42.508 | Brass '8X A2' Plc RegS FRN 16/11/2066 | 49.402 | 0,05 |
| EUR 441.000 | Supranationale Anleihen European Union RegS 2,625% 4/2/2048 | 389.443 | 0,41 | GBP 100.000 | British Telecommunications Plc RegS 5,75% 7/12/2028 | 115.374 | 0,12 |
| EUR 741.759 | European Union RegS 3,00% 4/3/2053 | 687.573 | 0,72 | EUR 100.000 | British Telecommunications Plc RegS FRN 18/8/2080 | 90.001 | 0,09 |
| EUR 76.000 | International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061 | 26.770 | 0,03 | GBP 100.000 | Cadent Finance Plc RegS 2,125% 22/9/2028 | 96.495 | 0,10 |
| | | 1.103.786 | 1,16 | GBP 94.828 | CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 109.746 | 0,12 |
| GBP 110.000 | Schweden Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 23/8/2032 | 115.840 | 0,12 | GBP 100.000 | Constellation Automotive Financing Plc RegS 4,875% 15/7/2027 | 88.505 | 0,09 |
| | | 115.840 | 0,12 | GBP 400.000 | Dowson '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 462.930 | 0,49 |
| GBP 271.000 | Schweiz Credit Suisse Group AG RegS FRN 12/9/2025 | 292.123 | 0,31 | GBP 300.200 | Economic Master Issuer '2023- 1 A' Plc RegS FRN 25/6/2074 | 349.073 | 0,37 |
| EUR 200.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2026 | 191.326 | 0,20 | GBP 185.833 | Elvet Mortgages '2020-1 A' Plc RegS FRN 22/3/2065 | 215.763 | 0,23 |
| GBP 250.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 9/6/2028 | 241.618 | 0,25 | GBP 254.952 | Gemgarto '2021-1X A' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 293.764 | 0,31 |
| EUR 500.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 1/3/2029 | 554.150 | 0,58 | GBP 100.000 | Heathrow Finance Plc RegS 5,75% 3/3/2025 | 113.700 | 0,12 |
| EUR 534.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 461.376 | 0,48 | GBP 99.994 | Hops Hill '1 B' Plc RegS FRN 27/5/2054 | 115.494 | 0,12 |
| EUR 400.000 | UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026 | 368.416 | 0,39 | GBP 746.190 | Hops Hill '2 A' Plc RegS FRN 27/11/2054 | 868.849 | 0,91 |
| EUR 200.000 | UBS Group AG RegS FRN 11/1/2031 | 195.682 | 0,20 | USD 30.000 | HSBC Bank Plc FRN 29/6/2049 | 28.053 | 0,03 |
| | | 2.304.691 | 2,41 | GBP 150.000 | HSBC Holdings Plc FRN 24/7/2027 | 150.699 | 0,16 |
| | | | | GBP 200.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2026 | 209.996 | 0,22 |
| | | | | EUR 100.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 16/11/2032 | 103.230 | 0,11 |
| | | | | GBP 450.000 | Imperial Brands Finance Plc RegS 8,125% 15/3/2024 | 529.227 | 0,55 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------------------------|--|------------------------|--------------------|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| EUR 300.000 | Informa Plc RegS 2,125% 6/10/2025 | 287.982 | 0,30 | GBP 218.993 | Silk Road Finance Number Six '2019-2 A' Plc RegS FRN 21/9/2067 | 253.967 | 0,27 |
| EUR 100.000 | Informa Plc RegS 1,25% 22/4/2028 | 88.034 | 0,09 | EUR 300.000 | Smiths Group Plc RegS 2,00% 23/2/2027 [*] | 281.043 | 0,29 |
| GBP 67.500 | Lanark Master Issuer '2020-1X 2A' Plc RegS FRN 22/12/2069 | 78.315 | 0,08 | EUR 450.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 2/7/2027 | 403.628 | 0,42 |
| GBP 173.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 B' Plc RegS FRN 20/7/2058 | 194.842 | 0,20 | GBP 264.123 | Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040 | 289.233 | 0,30 |
| GBP 288.000 | Lloyds Bank Plc RegS 7,625% 22/4/2025 | 341.857 | 0,36 | GBP 100.000 | Thames Water Utilities Finance Plc 6,75% 16/11/2028 | 120.608 | 0,13 |
| USD 360.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN 31/12/2099 | 310.721 | 0,33 | GBP 200.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,00% 19/6/2025 | 224.226 | 0,23 |
| EUR 350.000 | Lloyds Banking Group Plc RegS FRN 7/9/2028 | 345.860 | 0,36 | EUR 200.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,00% 18/4/2027 | 199.368 | 0,21 |
| GBP 209.541 | London Wall Mortgage Capital '2021-FL1 A' Plc RegS FRN 15/5/2051 | 240.331 | 0,25 | GBP 338.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 2,875% 3/5/2027 | 334.348 | 0,35 |
| GBP 300.000 | Marks & Spencer Plc RegS 6,00% 12/6/2025 | 343.163 | 0,36 | EUR 200.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 0,875% 31/1/2028 | 172.958 | 0,18 |
| GBP 283.000 | Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/9/2034 | 262.553 | 0,28 | EUR 100.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,375% 18/1/2031 | 100.324 | 0,11 |
| GBP 352.554 | Mortimer BTL '2021-1 A' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 403.842 | 0,42 | GBP 157.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 176.453 | 0,18 |
| EUR 100.000 | National Grid Plc RegS 3,245% 30/3/2034 | 91.104 | 0,10 | GBP 171.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X B' Plc RegS FRN 20/12/2063 | 194.689 | 0,20 |
| EUR 100.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 6/9/2028 | 98.505 | 0,10 | GBP 382.000 | Tower Bridge Funding '2023-1X A' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 445.611 | 0,47 |
| GBP 873.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 14/8/2030 | 943.444 | 0,99 | GBP 100.000 | TP ICAP Finance Plc RegS 7,875% 17/4/2030 | 111.874 | 0,12 |
| EUR 100.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 28/2/2034 | 100.667 | 0,11 | GBP 100.000 | Travis Perkins Plc RegS 4,50% 7/9/2023 | 114.551 | 0,12 |
| GBP 312.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029 | 361.121 | 0,38 | GBP 111.864 | Turbo Finance 9 Plc 'A' RegS FRN 20/8/2028 | 129.823 | 0,14 |
| GBP 350.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 18/6/2073 | 391.243 | 0,41 | GBP 274.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 306.878 | 0,32 |
| EUR 200.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079 | 189.192 | 0,20 | GBP 180.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,50% 7/9/2034 | 213.677 | 0,22 |
| GBP 660.323 | Oat Hill '2 A' Plc RegS FRN 27/5/2046 | 766.321 | 0,80 | GBP 484.000 | United Kingdom Gilt RegS 1,25% 31/7/2051 | 273.044 | 0,29 |
| GBP 4.131 | Orbita Funding '2020-1 A' Plc RegS FRN 17/3/2027 | 4.790 | 0,01 | GBP 119.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,00% 22/10/2063 | 127.196 | 0,13 |
| GBP 535.780 | Pierpont BTL '2021-1 A' Plc RegS FRN 22/12/2053 | 615.596 | 0,64 | GBP 241.000 | United Kingdom Inflation- Linked Gilt RegS 0,625% 22/3/2045 | 252.442 | 0,26 |
| GBP 802.000 | Pierpont BTL '2021-1 B' Plc RegS FRN 22/12/2053 | 902.884 | 0,95 | GBP 70.212 | United Kingdom Inflation- Linked Gilt RegS 0,125% 22/3/2051 | 62.254 | 0,07 |
| GBP 402.058 | Prs Finance Plc RegS 1,75% 24/11/2026 | 418.251 | 0,44 | GBP 100.000 | Virgin Media Secured Finance Plc RegS 5,00% 15/4/2027 | 105.785 | 0,11 |
| GBP 300.000 | Prs Finance Plc RegS 2,00% 23/1/2029 | 300.070 | 0,31 | EUR 200.000 | Vodafone Group Plc RegS FRN 3/1/2079 | 199.128 | 0,21 |
| GBP 279.855 | Residential Mortgage Securities '32X A' Plc RegS FRN 20/6/2070 | 325.046 | 0,34 | EUR 100.000 | Vodafone Group Plc RegS FRN 27/8/2080 | 89.769 | 0,09 |
| GBP 135.000 | RMAC NO 2 '2018-2 B' Plc RegS FRN 12/6/2046 | 156.490 | 0,16 | | | 21.268.069 | 22,28 |
| GBP 385.000 | Sage AR Funding '1X B' Plc RegS FRN 17/11/2030 | 429.613 | 0,45 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| EUR 125.000 | Sage Group Plc RegS 3,82% 15/2/2028 | 124.843 | 0,13 | USD 69.468 | Ajax Mortgage Loan Trust '2021-G A' FRN 25/6/2061 | 60.167 | 0,06 |
| GBP 200.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS 3,625% 14/1/2026 | 216.131 | 0,23 | USD 138.127 | American Airlines '2016-1 AA' Pass Through Trust 3,575% 15/1/2028 | 119.217 | 0,12 |
| GBP 200.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 8/5/2026 | 214.708 | 0,22 | | | | |
| USD 199.545 | SCC Power Plc RegS 8,00% 31/12/2028 | 66.157 | 0,07 | | | | |
| USD 108.086 | SCC Power Plc RegS 4,00% 17/5/2032 | 10.384 | 0,01 | | | | |

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 242.179 | American Airlines '2017-1 B' Pass Through Trust 4,95% 15/2/2025 | 218.391 | 0,23 | EUR 100.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 53.273 | 0,06 |
| EUR 600.000 | American Tower Corp 0,45% 15/1/2027 | 525.681 | 0,55 | EUR 200.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC RegS 6,375% 15/12/2030 | 198.556 | 0,21 |
| EUR 100.000 | American Tower Corp 0,40% 15/2/2027 | 87.445 | 0,09 | GBP 100.000 | Encore Capital Group Inc RegS 4,25% 1/6/2028 | 88.413 | 0,09 |
| EUR 100.000 | American Tower Corp 4,125% 16/5/2027 | 99.963 | 0,10 | EUR 100.000 | Fidelity National Information Services Inc 1,50% 21/5/2027 | 91.040 | 0,10 |
| GBP 200.000 | AT&T Inc 2,90% 4/12/2026 | 211.223 | 0,22 | EUR 100.000 | Fiserv Inc 4,50% 24/5/2031 | 101.093 | 0,11 |
| EUR 100.000 | AT&T Inc FRN 31/12/2099 | 92.563 | 0,10 | GBP 100.000 | Ford Motor Credit Co LLC 2,748% 14/6/2024 | 110.866 | 0,12 |
| EUR 100.000 | Autoliv Inc RegS 4,25% 15/3/2028 | 100.129 | 0,10 | GBP 140.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4,535% 6/3/2025 | 154.572 | 0,16 |
| USD 200.000 | BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2015-200P B' 3,49% 14/4/2033 | 173.358 | 0,18 | USD 23.741 | Freddie Mac REMICS '4390 CA' 3,50% 15/6/2050 | 21.664 | 0,02 |
| EUR 100.000 | Bank of America Corp RegS FRN 9/5/2030 | 85.035 | 0,09 | USD 28.060 | Freddie Mac REMICS '4459 BN' 3,00% 15/8/2043 | 24.195 | 0,03 |
| USD 100.000 | BBCMS '2017-DELC E' Mortgage Trust FRN 15/8/2036 | 93.597 | 0,10 | USD 4.275 | Freddie Mac REMICS '4482 DH' 3,00% 15/6/2042 | 3.926 | 0,00 |
| USD 100.000 | BBCMS '2017-DELC F' Mortgage Trust FRN 15/8/2036 | 92.268 | 0,10 | USD 170.000 | Freeport-McMoRan Inc 5,00% 1/9/2027 | 155.523 | 0,16 |
| EUR 100.000 | Belden Inc RegS 3,375% 15/7/2031 | 86.974 | 0,09 | USD 53.359.014 | FREMF '2015-K151 X2A' Mortgage Trust 0,10% 25/4/2030 | 226.274 | 0,24 |
| USD 160.000 | BHMS '2018-ATLS A' FRN 15/7/2035 | 145.995 | 0,15 | USD 100.000 | FREMF 2018-W5FX CFX' Trust FRN 25/4/2028 | 78.748 | 0,08 |
| USD 166.000 | BHMS '2018-ATLS C' FRN 15/7/2035 | 150.192 | 0,16 | EUR 100.000 | General Mills Inc 3,907% 13/4/2029 | 101.061 | 0,11 |
| EUR 100.000 | Boxer Parent Co Inc RegS 6,50% 2/10/2025 | 98.075 | 0,10 | GBP 100.000 | General Motors Financial Co Inc RegS 2,35% 3/9/2025 | 107.078 | 0,11 |
| USD 100.000 | BX Trust '2018-BILT D' FRN 15/5/2030 | 91.448 | 0,10 | EUR 100.000 | Global Payments Inc 4,875% 17/3/2031 | 101.302 | 0,11 |
| USD 588.000 | Capital One Financial Corp FRN 1/2/2029 | 535.133 | 0,56 | EUR 100.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 82.814 | 0,09 |
| USD 357.000 | Cargo Aircraft Management Inc 4,75% 1/2/2028 | 290.806 | 0,30 | USD 397.686 | GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust '2022-3CS A' 4,95% 20/7/2049 | 353.040 | 0,37 |
| USD 5.026.177 | CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 XA' FRN 10/5/2058 | 160.446 | 0,17 | USD 1.806.454 | Government National Mortgage Association '2017- 64 IO' FRN 16/11/2057 | 65.412 | 0,07 |
| USD 51.798 | Chase Mortgage Finance Corp '2016-SH1 M3' FRN 25/4/2045 | 43.350 | 0,05 | USD 70.000 | Gray Oak Pipeline LLC 2,00% 15/9/2023 | 64.791 | 0,07 |
| USD 205.000 | Citigroup Inc FRN 25/5/2034 | 194.827 | 0,20 | USD 155.000 | Gray Oak Pipeline LLC 2,60% 15/10/2025 | 134.043 | 0,14 |
| USD 10.000 | City of Riverside CA Electric Revenue 7,605% 1/10/2040 | 11.841 | 0,01 | USD 125.000 | GS Mortgage Securities Trust '2015-GS1 A3' 3,734% 10/11/2048 | 111.695 | 0,12 |
| USD 160.000 | COMM '2014-UBS5 B' Mortgage Trust FRN 10/9/2047 | 138.787 | 0,15 | USD 12.627 | GS Mortgage-Backed Securities Trust '2014-EB1A 2A1' FRN 25/7/2044 | 11.787 | 0,01 |
| USD 92.000 | COMM '2015-CR25 C' Mortgage Trust FRN 10/8/2048 | 75.744 | 0,08 | USD 100.000 | Houston Galleria Mall Trust '2015-HGLR D' 3,982% 5/3/2037 | 82.088 | 0,09 |
| USD 168.122 | COMM '2015-CR27 B' Mortgage Trust FRN 10/10/2048 | 141.184 | 0,15 | USD 117.367 | HSI Asset Securitization Corp Trust '2007-NC1 A2' FRN 25/4/2037 | 68.849 | 0,07 |
| USD 5.000 | Commonwealth Financing Authority 4,144% 1/6/2038 | 4.253 | 0,00 | USD 9.156 | JP Morgan Mortgage Trust '2018-4 A1' FRN 25/10/2048 | 7.684 | 0,01 |
| USD 29.000 | CSAIL '2015-C4 D' Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2048 | 21.596 | 0,02 | USD 132.800 | JP Morgan Mortgage Trust '2018-4 B4' FRN 25/10/2048 | 99.759 | 0,10 |
| USD 77.215 | Delta Air Lines '2015-1 B' Pass Through Trust 4,25% 30/7/2023 | 72.178 | 0,08 | EUR 400.000 | Kinder Morgan Inc 2,25% 16/3/2027 | 374.572 | 0,39 |
| USD 142.000 | Delta Air Lines '2019-1 AA' Pass Through Trust 3,204% 25/4/2024 | 129.761 | 0,14 | USD 100.000 | Kinder Morgan Inc 5,20% 1/6/2033 | 90.563 | 0,09 |
| EUR 100.000 | Duke Energy Corp 3,10% 15/6/2028 | 95.398 | 0,10 | USD 45.000 | Level 3 Financing Inc 3,75% 15/7/2029 | 23.063 | 0,02 |
| USD 414.000 | Edison International FRN 15/6/2053 | 397.425 | 0,42 | USD 94.354 | Loanpal Solar Loan '2020-3GS A' Ltd 2,47% 20/12/2047 | 70.784 | 0,07 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 26.811 | Mastr Asset Backed Securities Trust '2005-WF1 M7' FRN 25/6/2035 | 24.976 | 0,03 | EUR 100.000 | Southern Co FRN 15/9/2081 | 78.302 | 0,08 |
| USD 98.137 | Mastr Asset Backed Securities Trust '2005-WF1 M8' FRN 25/6/2035 | 91.591 | 0,10 | GBP 100.000 | Time Warner Cable LLC 5,75% 2/6/2031 | 108.245 | 0,11 |
| USD 109.449 | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust '2007-H1 1A2' FRN 25/10/2037 | 89.114 | 0,09 | USD 140.792 | United Airlines 2019-2 Class A Pass Through Trust 'A' 2,90% 1/5/2028 | 113.269 | 0,12 |
| USD 150.000 | Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,10% 15/5/2028 | 135.222 | 0,14 | USD 143.442 | United Airlines 2019-2 Class B Pass Through Trust 'B' 3,50% 1/5/2028 | 121.438 | 0,13 |
| EUR 300.000 | MMS USA Holdings Inc RegS 1,25% 13/6/2028 | 267.462 | 0,28 | USD 17.125 | United Airlines '2020-1 B' Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026 | 15.191 | 0,02 |
| EUR 155.000 | Morgan Stanley FRN 7/5/2032 | 140.948 | 0,15 | USD 201.231 | United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 'A' 5,875% 15/10/2027 | 185.889 | 0,19 |
| EUR 118.000 | Morgan Stanley FRN 29/4/2033 | 89.604 | 0,09 | USD 5.000 | University of California 5,77% 15/5/2043 | 5.001 | 0,01 |
| USD 500.000 | Morgan Stanley Capital I Trust '2014-150E A' 3,912% 9/9/2032 | 374.476 | 0,39 | GBP 100.000 | Wells Fargo & Co RegS FRN 26/4/2028 | 104.313 | 0,11 |
| USD 22.782 | Morgan Stanley Capital I Trust '2017-H1 C' FRN 15/6/2050 | 18.764 | 0,02 | GBP 200.000 | Wells Fargo Bank NA RegS 5,25% 1/8/2023 | 231.567 | 0,24 |
| USD 144.931 | Morgan Stanley Capital I Trust '2018-H3 B' FRN 15/7/2051 | 119.483 | 0,13 | USD 8.840.123 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-C41 XA' FRN 15/11/2050 | 338.770 | 0,35 |
| USD 54.418 | Mosaic Solar Loan Trust '2020-2A A' 1,44% 20/8/2046 | 42.483 | 0,04 | USD 30.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2018-C45 C' 4,727% 15/6/2051 | 23.277 | 0,02 |
| USD 29.490 | Mosaic Solar Loans '2017-2A A' LLC 3,82% 22/6/2043 | 25.734 | 0,03 | USD 200.000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2018-C48 C' FRN 15/1/2052 | 154.232 | 0,16 |
| EUR 170.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0,993% 15/10/2026 | 123.476 | 0,13 | GBP 100.000 | Welltower OP LLC 4,80% 20/11/2028 | 107.233 | 0,11 |
| USD 137.081 | MSCG Trust '2018-SELF E' FRN 15/10/2037 | 123.838 | 0,13 | USD 5.814 | WinWater Mortgage Loan Trust '2015-3 A3' FRN 20/3/2045 | 5.066 | 0,01 |
| USD 31.236 | New Residential Mortgage Loan Trust '2018-1A A1A' FRN 25/12/2057 | 27.971 | 0,03 | | | 12.867.685 | 13,48 |
| USD 15.000 | New York State Dormitory Authority 3,19% 15/2/2043 | 11.009 | 0,01 | | | 74.351.918 | 77,88 |
| USD 49.032 | Newcastle Mortgage Securities Trust '2007-1 2A3' FRN 25/4/2037 | 44.513 | 0,05 | Gesamt Anleihen | | | |
| USD 595.000 | NextEra Energy Operating Partners LP 4,25% 15/7/2024 | 545.891 | 0,57 | EINLAGENZERTIFIKATE | | | |
| USD 200.000 | Norfolk Southern Corp 4,45% 1/3/2033 | 180.520 | 0,19 | Kanada | | | |
| EUR 100.000 | Olympus Water US Holding Corp RegS 9,625% 15/11/2028 | 100.437 | 0,11 | USD 50.000 | Royal Bank of Canada 4,08% 14/7/2023 | 46.827 | 0,05 |
| USD 32.133 | OneMain Financial Issuance Trust '2020-1A A' 3,84% 14/5/2032 | 29.886 | 0,03 | USD 20.000 | Toronto-Dominion Bank 4,07% 18/7/2023 | 18.731 | 0,02 |
| USD 15.000 | Oracle Corp 5,55% 6/2/2053 | 13.064 | 0,01 | | | 65.558 | 0,07 |
| USD 10.000 | Oregon School Boards Association 5,55% 30/6/2028 | 9.533 | 0,01 | Gesamt Einlagenzertifikate | | 65.558 | 0,07 |
| USD 250.000 | Pacific Gas and Electric Co 4,95% 1/7/2050 | 180.852 | 0,19 | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| USD 225.000 | Regency Centers LP 3,70% 15/6/2030 | 189.812 | 0,20 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 25.000 | Rutgers The State University of New Jersey 3,27% 1/5/2043 | 18.383 | 0,02 | USD 800.000 | AT&T Inc 19/3/2024 (Zero Coupon) | 714.599 | 0,75 |
| USD 110.000 | SMB Private Education Loan Trust '2020-PTB B' 2,50% 15/9/2054 | 84.680 | 0,09 | USD 670.000 | Enel Finance America LLC 18/8/2023 (Zero Coupon) | 618.583 | 0,65 |
| USD 100.000 | Southern California Edison Co 3,65% 1/2/2050 | 69.192 | 0,07 | | | 1.333.182 | 1,40 |
| | | | | Gesamt kurzfristige Titel | | 1.333.182 | 1,40 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| Irland | | | |
| EUR 10.541 | iShares Core EUR Corp Bond UCITS ETF ⁻ | 1.222.545 | 1,28 |
| EUR 4.163 | iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF ^{-^} | 375.294 | 0,39 |
| GBP 66.001 | iShares GBP Corp Bond 0-5yr UCITS ETF ⁻ | 7.367.637 | 7,72 |
| | | 8.965.476 | 9,39 |
| Gesamt börsengehandelte Fonds | | 8.965.476 | 9,39 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 84.716.134 | 88,74 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 5.665 | Blackrock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund 'U' ⁻ | 538.906 | 0,56 |
| | | 538.906 | 0,56 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 538.906 | 0,56 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 85.255.040 | 89,30 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 10.212.791 | 10,70 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 95.467.831 | 100,00 |
| [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR |
|---|-----------------------|-------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | |
| | Italien | | |
| 1.427 | Lottomatica Group SpA | HSBC | (1.350) |
| | | | (1.350) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – EUR 10.757) | | | (1.350) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDS | USD 7.845 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.40 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (43) | (81) |
| CCCDS | USD 2.795.388 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.40 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (4.564) | (29.398) |
| CCCDS | EUR 14.117.350 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (48.918) | (381.970) |
| CCCDS | EUR 22.990.000 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (63.012) | (194.255) |
| CCCDS | EUR 3.637.939 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Subordinated Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (22.274) | 116.681 |
| CCILS | EUR 1.360.000 | Fund receives Fixed 2,235% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2033 | (34.848) | (34.711) |
| CCILS | EUR 390.000 | Fund receives Fixed 2,380% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | (3.494) | (3.486) |
| CCILS | EUR 2.780.000 | Fund receives Fixed 2,458% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2032 | (44.965) | (44.907) |
| CCILS | USD 280.000 | Fund receives Fixed 2,466% and pays Floating USD 12 Month CPURNSA | Bank of America Merrill Lynch | 23/3/2033 | (1.204) | (1.199) |
| CCILS | USD 60.000 | Fund receives Fixed 2,490% and pays Floating USD 12 Month CPURNSA | Bank of America Merrill Lynch | 18/5/2033 | (56) | (55) |
| CCILS | USD 380.000 | Fund receives Fixed 2,500% and pays Floating USD 12 Month CPURNSA | Bank of America Merrill Lynch | 14/4/2033 | 18 | 25 |
| CCILS | EUR 2.180.000 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2032 | (25.374) | (25.350) |
| CCILS | USD 240.000 | Fund receives Fixed 2,528% and pays Floating USD 12 Month CPURNSA | Bank of America Merrill Lynch | 13/4/2033 | 567 | 572 |
| CCILS | EUR 560.000 | Fund receives Fixed 2,574% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (634) | (619) |
| CCILS | EUR 520.000 | Fund receives Fixed 2,601% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2043 | (4.683) | (4.315) |
| CCILS | EUR 435.000 | Fund receives Fixed 2,640% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2033 | 3.018 | 3.028 |
| CCILS | EUR 1.180.000 | Fund receives Fixed 2,676% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2032 | (5.156) | (5.132) |
| CCILS | EUR 970.000 | Fund receives Fixed 2,706% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2032 | (1.397) | (1.376) |
| CCILS | GBP 91.000 | Fund receives Fixed 3,313% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2053 | (1.753) | (1.748) |
| CCILS | GBP 86.000 | Fund receives Fixed 3,480% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2043 | (1.602) | (1.650) |
| CCILS | GBP 143.000 | Fund receives Fixed 3,618% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2031 | (30.551) | (30.549) |
| CCILS | GBP 210.000 | Fund receives Fixed 3,773% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2033 | (2.207) | (1.202) |
| CCILS | GBP 906.000 | Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2028 | (140.290) | (140.138) |
| CCILS | GBP 640.000 | Fund receives Fixed 3,778% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2033 | (2.591) | (3.312) |
| CCILS | GBP 250.000 | Fund receives Fixed 3,955% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2033 | 2.238 | 2.244 |
| CCILS | GBP 304.000 | Fund receives Fixed 4,193% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2032 | (28.309) | (28.306) |
| CCILS | EUR 1.370.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,225% | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2028 | 18.238 | 18.144 |
| CCILS | EUR 510.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,435% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 1.733 | 1.905 |
| CCILS | EUR 2.780.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,625% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2027 | 16.499 | 16.532 |
| CCILS | EUR 2.210.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,700% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2027 | 5.020 | 5.024 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCILS | EUR 435.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,805% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2028 | (3.874) | (3.868) |
| CCILS | EUR 1.180.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,000% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2027 | (3.770) | (3.754) |
| CCILS | EUR 970.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 3,047% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2027 | (5.354) | (5.341) |
| CCILS | GBP 190.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,358% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2053 | 2.948 | 2.958 |
| CCILS | GBP 44.299 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,750% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2052 | (161) | (160) |
| CCILS | GBP 499.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 4,210% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2028 | (2.075) | (2.068) |
| CCILS | GBP 1.099.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,340% | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2027 | (18.759) | (18.751) |
| CCILS | USD 5.570.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 2,160% | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2025 | 13.806 | 13.836 |
| CCILS | USD 14.900.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 2,430% | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2023 | 56.076 | 56.102 |
| CCILS | USD 6.200.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 2,430% | Bank of America Merrill Lynch | 17/4/2025 | (16.495) | (16.462) |
| CCILS | USD 6.970.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 2,665% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2024 | 7.760 | 7.785 |
| CCILS | USD 2.390.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 2,710% | Bank of America Merrill Lynch | 22/2/2025 | (9.246) | (9.233) |
| CCIRS | CHF 220.000 | Fund receives Fixed 1,856% and pays Floating CHF 12 Month SARON | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2053 | 1.720 | 1.193 |
| CCIRS | EUR 3.170.000 | Fund receives Fixed 2,291% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 5/2/2028 | (13.442) | (13.422) |
| CCIRS | EUR 72.000 | Fund receives Fixed 2,443% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 14/7/2032 | (1.045) | (1.044) |
| CCIRS | EUR 190.000 | Fund receives Fixed 2,681% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | 192 | 194 |
| CCIRS | EUR 230.000 | Fund receives Fixed 2,684% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | 266 | 269 |
| CCIRS | EUR 470.000 | Fund receives Fixed 2,708% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 27/3/2033 | (1.392) | 1.011 |
| CCIRS | EUR 640.000 | Fund receives Fixed 2,728% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/4/2033 | 1.520 | 1.878 |
| CCIRS | EUR 280.000 | Fund receives Fixed 2,735% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 18/4/2033 | 850 | 853 |
| CCIRS | EUR 290.000 | Fund receives Fixed 2,738% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 18/4/2033 | 922 | 925 |
| CCIRS | EUR 97.500 | Fund receives Fixed 2,758% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 6/5/2043 | 74 | 76 |
| CCIRS | EUR 97.500 | Fund receives Fixed 2,761% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 6/5/2043 | 90 | 92 |
| CCIRS | EUR 710.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2033 | 3.197 | 3.073 |
| CCIRS | EUR 195.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/5/2043 | 372 | 312 |
| CCIRS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 2,832% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2033 | 841 | 843 |
| CCIRS | EUR 3.630.000 | Fund receives Fixed 2,843% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2033 | (6.250) | (30.194) |
| CCIRS | EUR 450.000 | Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2033 | 4.035 | 3.849 |
| CCIRS | KRW 90.290.000 | Fund receives Fixed 2,930% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (966) | (966) |
| CCIRS | KRW 90.290.000 | Fund receives Fixed 2,943% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (928) | (928) |
| CCIRS | EUR 580.000 | Fund receives Fixed 2,962% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | 1.744 | 1.827 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|--|-------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | KRW 42.530.000 | Fund receives Fixed 3,020% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (330) | (330) |
| CCIRS | USD 6.150.000 | Fund receives Fixed 3,034% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2033 | (116.456) | (165.844) |
| CCIRS | KRW 152.890.000 | Fund receives Fixed 3,045% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (1.064) | (1.063) |
| CCIRS | KRW 48.400.000 | Fund receives Fixed 3,055% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (321) | (321) |
| CCIRS | HKD 145.000 | Fund receives Fixed 3,060% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (496) | (496) |
| CCIRS | GBP 223.000 | Fund receives Fixed 3,064% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 3/2/2053 | (36.149) | (36.134) |
| CCIRS | KRW 72.020.000 | Fund receives Fixed 3,070% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (443) | (442) |
| CCIRS | KRW 63.790.000 | Fund receives Fixed 3,087% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (357) | (356) |
| CCIRS | EUR 1.790.000 | Fund receives Fixed 3,088% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2028 | (2.454) | 6.020 |
| CCIRS | GBP 640.000 | Fund receives Fixed 3,088% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2053 | (89.263) | (100.053) |
| CCIRS | GBP 580.000 | Fund receives Fixed 3,090% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 2/2/2027 | (5.785) | (5.735) |
| CCIRS | HKD 145.000 | Fund receives Fixed 3,100% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (465) | (465) |
| CCIRS | HKD 780.000 | Fund receives Fixed 3,120% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (2.416) | (2.415) |
| CCIRS | KRW 157.870.000 | Fund receives Fixed 3,130% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (663) | (661) |
| CCIRS | KRW 172.160.000 | Fund receives Fixed 3,132% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (712) | (710) |
| CCIRS | GBP 128.500 | Fund receives Fixed 3,135% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2053 | (18.223) | (19.001) |
| CCIRS | GBP 620.000 | Fund receives Fixed 3,175% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 26/1/2028 | (4.008) | (3.988) |
| CCIRS | KRW 179.932.450 | Fund receives Fixed 3,188% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | (468) | (467) |
| CCIRS | KRW 132.993.550 | Fund receives Fixed 3,190% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | (340) | (339) |
| CCIRS | GBP 380.000 | Fund receives Fixed 3,197% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2028 | (2.237) | (2.268) |
| CCIRS | GBP 860.000 | Fund receives Fixed 3,200% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 26/1/2028 | (5.606) | (5.329) |
| CCIRS | HKD 119.250 | Fund receives Fixed 3,230% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (298) | (298) |
| CCIRS | HKD 345.000 | Fund receives Fixed 3,231% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (862) | (861) |
| CCIRS | HKD 330.750 | Fund receives Fixed 3,235% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (819) | (818) |
| CCIRS | GBP 13.700.000 | Fund receives Fixed 3,275% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 10/2/2028 | (183.767) | (183.665) |
| CCIRS | KRW 56.658.334 | Fund receives Fixed 3,330% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | 15 | 15 |
| CCIRS | GBP 30.000 | Fund receives Fixed 3,342% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (1.581) | (1.580) |
| CCIRS | GBP 658.500 | Fund receives Fixed 3,362% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 2/2/2028 | (36.374) | (36.355) |
| CCIRS | KRW 56.666.833 | Fund receives Fixed 3,380% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | 72 | 72 |
| CCIRS | KRW 56.666.833 | Fund receives Fixed 3,382% and pays Floating KRW 3 Month KWDCDC | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2026 | 74 | 75 |
| CCIRS | GBP 100.000 | Fund receives Fixed 3,418% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (4.889) | (4.887) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|-------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | AUD 730.000 | Fund receives Fixed 3,425% and pays Floating AUD 3 Month BBSW | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | (4.615) | (3.848) |
| CCIRS | GBP 1.170.000 | Fund receives Fixed 3,447% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2027 | (8.792) | (7.067) |
| CCIRS | GBP 100.000 | Fund receives Fixed 3,492% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (4.518) | (4.517) |
| CCIRS | KRW 300.550.000 | Fund receives Fixed 3,500% and pays Floating KRW 3 Month KWDCD | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 2.357 | 2.360 |
| CCIRS | USD 1.280.000 | Fund receives Fixed 3,508% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | (10.089) | (10.041) |
| CCIRS | CAD 150.000 | Fund receives Fixed 3,528% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (723) | (965) |
| CCIRS | USD 1.500.000 | Fund receives Fixed 3,544% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | (10.081) | (10.364) |
| CCIRS | USD 950.000 | Fund receives Fixed 3,550% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | (9.229) | (6.406) |
| CCIRS | GBP 13.170.000 | Fund receives Fixed 3,567% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 14/2/2027 | (181.623) | (181.525) |
| CCIRS | EUR 2.480.000 | Fund receives Fixed 3,575% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2025 | 12.503 | 12.510 |
| CCIRS | GBP 610.000 | Fund receives Fixed 3,600% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 17/3/2026 | (4.835) | (4.863) |
| CCIRS | GBP 1.298.000 | Fund receives Fixed 3,600% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 31/1/2028 | (57.394) | (56.978) |
| CCIRS | CAD 90.000 | Fund receives Fixed 3,609% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (332) | (353) |
| CCIRS | GBP 80.000 | Fund receives Fixed 3,610% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (3.145) | (3.144) |
| CCIRS | AUD 1.670.000 | Fund receives Fixed 3,628% and pays Floating AUD 3 Month BBSW | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | (7.830) | (3.004) |
| CCIRS | GBP 60.000 | Fund receives Fixed 3,630% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (2.297) | (2.296) |
| CCIRS | GBP 80.000 | Fund receives Fixed 3,653% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (2.940) | (2.973) |
| CCIRS | CAD 130.000 | Fund receives Fixed 3,670% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (408) | (267) |
| CCIRS | GBP 6.960.000 | Fund receives Fixed 3,677% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 9/3/2027 | (31.773) | (26.840) |
| CCIRS | GBP 300.000 | Fund receives Fixed 3,700% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2026 | (2.043) | (2.043) |
| CCIRS | CAD 80.000 | Fund receives Fixed 3,725% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 46 | (30) |
| CCIRS | GBP 30.000 | Fund receives Fixed 3,730% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (1.000) | (1.000) |
| CCIRS | GBP 720.000 | Fund receives Fixed 3,753% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 17/3/2026 | (6.490) | (4.618) |
| CCIRS | CAD 90.000 | Fund receives Fixed 3,790% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 65 | 146 |
| CCIRS | GBP 50.000 | Fund receives Fixed 3,870% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (1.086) | (1.314) |
| CCIRS | GBP 30.000 | Fund receives Fixed 3,876% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (780) | (780) |
| CCIRS | CAD 80.000 | Fund receives Fixed 3,879% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 186 | 349 |
| CCIRS | GBP 100.000 | Fund receives Fixed 3,902% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (2.470) | (2.469) |
| CCIRS | GBP 70.000 | Fund receives Fixed 3,918% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (1.486) | (1.671) |
| CCIRS | GBP 3.920.000 | Fund receives Fixed 3,925% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2025 | (108.491) | (94.498) |
| CCIRS | GBP 970.000 | Fund receives Fixed 3,972% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | (25.518) | (25.507) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|---|-------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | GBP 1.470.000 | Fund receives Fixed 4,056% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2028 | (31.329) | (31.307) |
| CCIRS | GBP 190.000 | Fund receives Fixed 4,113% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 17/1/2025 | (3.711) | (3.540) |
| CCIRS | GBP 11.690.000 | Fund receives Fixed 4,140% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 27/3/2025 | (221.956) | (221.879) |
| CCIRS | AUD 250.000 | Fund receives Fixed 4,150% and pays Floating AUD 6 Month BBSW | Bank of America Merrill Lynch | 9/2/2033 | 966 | 969 |
| CCIRS | GBP 3.840.000 | Fund receives Fixed 4,172% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 4/4/2025 | (67.702) | (70.719) |
| CCIRS | GBP 308.200 | Fund receives Fixed 4,255% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2026 | (5.464) | (5.461) |
| CCIRS | GBP 270.000 | Fund receives Fixed 4,266% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2026 | (4.693) | (4.689) |
| CCIRS | GBP 3.060.000 | Fund receives Fixed 4,272% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 14/2/2025 | (49.222) | (49.239) |
| CCIRS | GBP 799.920 | Fund receives Fixed 4,279% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2033 | 12.799 | 13.534 |
| CCIRS | GBP 800.040 | Fund receives Fixed 4,279% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2033 | 8.141 | 13.536 |
| CCIRS | GBP 1.630.000 | Fund receives Fixed 4,287% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 28/4/2026 | (27.433) | (27.423) |
| CCIRS | CZK 2.095.000 | Fund receives Fixed 4,321% and pays Floating CZK 6 Month PRIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (515) | (514) |
| CCIRS | CZK 1.260.000 | Fund receives Fixed 4,440% and pays Floating CZK 6 Month PRIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (30) | (29) |
| CCIRS | CZK 730.000 | Fund receives Fixed 4,504% and pays Floating CZK 6 Month PRIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 69 | 70 |
| CCIRS | GBP 900.000 | Fund receives Fixed 4,505% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/5/2025 | (9.787) | (10.532) |
| CCIRS | CZK 1.770.000 | Fund receives Fixed 4,542% and pays Floating CZK 6 Month PRIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 297 | 298 |
| CCIRS | GBP 3.200.000 | Fund receives Fixed 4,560% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2025 | (34.063) | (34.096) |
| CCIRS | GBP 10.960.000 | Fund receives Fixed 4,565% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2025 | (115.676) | (115.749) |
| CCIRS | GBP 1.600.000 | Fund receives Fixed 4,576% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2025 | (16.524) | (16.535) |
| CCIRS | NZD 1.295.000 | Fund receives Fixed 4,697% and pays Floating NZD 3 Month BBR | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2024 | (3.619) | (3.616) |
| CCIRS | GBP 3.269.000 | Fund receives Fixed 4,750% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2025 | (19.469) | (21.107) |
| CCIRS | GBP 4.300.000 | Fund receives Fixed 4,777% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2025 | (25.620) | (25.289) |
| CCIRS | NZD 1.210.000 | Fund receives Fixed 4,940% and pays Floating NZD 3 Month BBR | Bank of America Merrill Lynch | 10/2/2025 | (4.404) | (4.400) |
| CCIRS | GBP 8.670.000 | Fund receives Fixed 5,007% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 24/5/2025 | (7.926) | (8.036) |
| CCIRS | PLN 180.000 | Fund receives Fixed 5,130% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (159) | (159) |
| CCIRS | PLN 210.000 | Fund receives Fixed 5,234% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 17 | 18 |
| CCIRS | PLN 100.000 | Fund receives Fixed 5,345% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 111 | 112 |
| CCIRS | PLN 200.000 | Fund receives Fixed 5,368% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 265 | 265 |
| CCIRS | PLN 140.000 | Fund receives Fixed 5,390% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 215 | 215 |
| CCIRS | PLN 260.000 | Fund receives Fixed 5,438% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 515 | 515 |
| CCIRS | PLN 390.000 | Fund receives Fixed 5,450% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 814 | 815 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | PLN 190.000 | Fund receives Fixed 5,450% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 397 | 398 |
| CCIRS | CZK 7.279.000 | Fund receives Fixed 6,740% and pays Floating CZK 3 Month PRIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2024 | (210) | (209) |
| CCIRS | ZAR 4.213.000 | Fund receives Fixed 7,200% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/3/2025 | (3.264) | (3.263) |
| CCIRS | MXN 874.000 | Fund receives Fixed 8,350% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 28/4/2028 | (295) | (295) |
| CCIRS | MXN 1.785.000 | Fund receives Fixed 8,420% and pays Floating MXN 1 Month TIIE | Bank of America Merrill Lynch | 20/1/2028 | (485) | (485) |
| CCIRS | ZAR 1.590.000 | Fund receives Fixed 8,421% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (3.264) | (3.263) |
| CCIRS | ZAR 1.710.000 | Fund receives Fixed 8,571% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (3.038) | (3.037) |
| CCIRS | ZAR 1.020.000 | Fund receives Fixed 9,040% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (932) | (931) |
| CCIRS | ZAR 1.220.000 | Fund receives Fixed 9,345% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (430) | (429) |
| CCIRS | ZAR 840.000 | Fund receives Fixed 9,375% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (249) | (249) |
| CCIRS | ZAR 630.000 | Fund receives Fixed 9,400% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (158) | (158) |
| CCIRS | ZAR 990.000 | Fund receives Fixed 9,500% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (66) | (66) |
| CCIRS | AUD 680.000 | Fund receives Floating AUD 3 Month BBSW and pays Fixed 3,342% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 4.552 | 4.556 |
| CCIRS | AUD 720.000 | Fund receives Floating AUD 3 Month BBSW and pays Fixed 3,482% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 3.107 | 3.097 |
| CCIRS | AUD 1.090.000 | Fund receives Floating AUD 3 Month BBSW and pays Fixed 3,802% | Bank of America Merrill Lynch | 9/2/2025 | 1.511 | 1.514 |
| CCIRS | AUD 16.620.000 | Fund receives Floating AUD 3 Month BBSW and pays Fixed 3,885% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2024 | 19.286 | 19.335 |
| CCIRS | AUD 1.120.000 | Fund receives Floating AUD 3 Month BBSW and pays Fixed 4,043% | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2024 | (806) | (802) |
| CCIRS | AUD 50.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,385% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 598 | 599 |
| CCIRS | AUD 100.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,464% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 981 | 982 |
| CCIRS | AUD 120.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,512% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 1.020 | 1.021 |
| CCIRS | AUD 110.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,547% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 830 | 831 |
| CCIRS | AUD 60.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,603% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 361 | 362 |
| CCIRS | AUD 40.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,637% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 204 | 204 |
| CCIRS | AUD 60.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,684% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 229 | 230 |
| CCIRS | AUD 60.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,689% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 221 | 221 |
| CCIRS | AUD 100.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,708% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 316 | 316 |
| CCIRS | AUD 110.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,743% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 242 | 243 |
| CCIRS | AUD 110.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,750% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 221 | 222 |
| CCIRS | AUD 60.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,758% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 108 | 109 |
| CCIRS | AUD 50.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,796% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 38 | 38 |
| CCIRS | AUD 130.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,798% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 91 | 92 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | CAD 640.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,723% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 7.195 | 7.082 |
| CCIRS | CAD 90.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,738% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 863 | 970 |
| CCIRS | CHF 20.000 | Fund receives Floating CHF 12 Month SARON and pays Fixed 1,870% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (158) | (147) |
| CCIRS | CHF 560.000 | Fund receives Floating CHF 12 Month SARON and pays Fixed 1,912% | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | (6.313) | (5.766) |
| CCIRS | CHF 2.400.000 | Fund receives Floating CHF 12 Month SARON and pays Fixed 2,120% | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2025 | (8.444) | (8.437) |
| CCIRS | CZK 8.319.000 | Fund receives Floating CZK 3 Month PRIBOR and pays Fixed 4,615% | Bank of America Merrill Lynch | 19/6/2025 | 267 | 268 |
| CCIRS | EUR 1.640.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 2,875% | Bank of America Merrill Lynch | 4/5/2028 | (8.896) | (8.880) |
| CCIRS | EUR 75.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,025% | Bank of America Merrill Lynch | 21/1/2061 | 43.813 | 43.721 |
| CCIRS | EUR 190.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,270% | Bank of America Merrill Lynch | 4/3/2053 | 12.261 | 12.267 |
| CCIRS | EUR 304.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,272% | Bank of America Merrill Lynch | 4/3/2053 | 19.556 | 19.566 |
| CCIRS | EUR 1.030.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,341% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2053 | 29.002 | 50.831 |
| CCIRS | EUR 230.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,508% | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2053 | 3.593 | 3.529 |
| CCIRS | EUR 380.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,668% | Bank of America Merrill Lynch | 4/2/2048 | 3.407 | 3.419 |
| CCIRS | EUR 2.770.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,866% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2028 | 8.100 | 18.898 |
| CCIRS | EUR 80.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,888% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 254 | 255 |
| CCIRS | EUR 50.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,078% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (275) | (274) |
| CCIRS | EUR 90.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,080% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (500) | (499) |
| CCIRS | EUR 110.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,148% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (954) | (953) |
| CCIRS | EUR 350.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,158% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 803 | 867 |
| CCIRS | EUR 2.530.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,160% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 7.087 | 6.123 |
| CCIRS | EUR 120.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,162% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (1.115) | (1.113) |
| CCIRS | EUR 40.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,179% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (422) | (403) |
| CCIRS | EUR 4.020.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,211% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 3.916 | 3.955 |
| CCIRS | EUR 440.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,240% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 226 | 74 |
| CCIRS | EUR 400.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,378% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | (1.507) | (1.488) |
| CCIRS | EUR 4.360.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,422% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2025 | 10.008 | 5.392 |
| CCIRS | GBP 416.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,168% | Bank of America Merrill Lynch | 24/11/2026 | 69.330 | 68.813 |
| CCIRS | GBP 355.500 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,181% | Bank of America Merrill Lynch | 2/2/2033 | 29.851 | 29.849 |
| CCIRS | GBP 318.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,200% | Bank of America Merrill Lynch | 7/7/2051 | 42.490 | 42.603 |
| CCIRS | GBP 1.410.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,214% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2033 | 99.654 | 114.996 |
| CCIRS | GBP 1.650.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,548% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2028 | 93.098 | 76.183 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | GBP 134.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,660% | Bank of America Merrill Lynch | 10/5/2053 | 6.415 | 5.680 |
| CCIRS | GBP 250.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,720% | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2033 | 5.346 | 8.836 |
| CCIRS | GBP 500.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,762% | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2033 | 15.742 | 15.742 |
| CCIRS | GBP 400.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 4,006% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 9.658 | 10.090 |
| CCIRS | GBP 360.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 4,223% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 6.601 | 6.614 |
| CCIRS | GBP 659.587 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 4,580% | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2028 | (3.845) | (3.562) |
| CCIRS | GBP 559.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 4,641% | Bank of America Merrill Lynch | 30/5/2028 | (4.819) | (4.809) |
| CCIRS | GBP 1.463.187 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 4,650% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2028 | (14.648) | (13.960) |
| CCIRS | GBP 1.463.406 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 4,650% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2028 | (9.878) | (13.962) |
| CCIRS | JPY 117.000.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,135% | Bank of America Merrill Lynch | 22/8/2027 | 3.203 | 3.212 |
| CCIRS | JPY 140.300.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,230% | Bank of America Merrill Lynch | 11/1/2025 | (2.673) | (2.669) |
| CCIRS | JPY 246.000.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,235% | Bank of America Merrill Lynch | 19/1/2025 | (4.834) | (4.826) |
| CCIRS | JPY 103.700.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,265% | Bank of America Merrill Lynch | 12/1/2025 | (2.370) | (2.367) |
| CCIRS | JPY 143.370.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,272% | Bank of America Merrill Lynch | 6/1/2025 | (3.374) | (3.369) |
| CCIRS | JPY 99.630.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,281% | Bank of America Merrill Lynch | 6/1/2025 | (2.437) | (2.433) |
| CCIRS | MXN 1.410.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,200% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | 73 | 74 |
| CCIRS | MXN 800.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,350% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (208) | (207) |
| CCIRS | MXN 2.370.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,365% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (689) | (688) |
| CCIRS | MXN 2.030.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,368% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (601) | (600) |
| CCIRS | MXN 1.510.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,380% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (486) | (485) |
| CCIRS | MXN 1.500.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,470% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (763) | (762) |
| CCIRS | MXN 950.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,820% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (1.173) | (1.173) |
| CCIRS | MXN 1.550.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,828% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (1.938) | (1.938) |
| CCIRS | MXN 12.440.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,858% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (16.332) | (16.325) |
| CCIRS | MXN 2.090.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,915% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (2.993) | (2.992) |
| CCIRS | MXN 2.213.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 9,840% | Bank of America Merrill Lynch | 16/5/2025 | (1) | (1) |
| CCIRS | NOK 450.000 | Fund receives Floating NOK 6 Month NIBOR and pays Fixed 3,406% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 233 | 316 |
| CCIRS | NOK 580.000 | Fund receives Floating NOK 6 Month NIBOR and pays Fixed 3,438% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 336 | 336 |
| CCIRS | NZD 110.000 | Fund receives Floating NZD 3 Month BBR and pays Fixed 4,140% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 537 | 538 |
| CCIRS | NZD 110.000 | Fund receives Floating NZD 3 Month BBR and pays Fixed 4,190% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 402 | 402 |
| CCIRS | NZD 280.000 | Fund receives Floating NZD 3 Month BBR and pays Fixed 4,252% | Bank of America Merrill Lynch | 10/2/2033 | 962 | 965 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | NZD 100.000 | Fund receives Floating NZD 3 Month BBR and pays Fixed 4,400% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (151) | (150) |
| CCIRS | NZD 110.000 | Fund receives Floating NZD 3 Month BBR and pays Fixed 4,478% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (376) | (375) |
| CCIRS | NZD 60.000 | Fund receives Floating NZD 3 Month BBR and pays Fixed 4,630% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (430) | (429) |
| CCIRS | PLN 537.000 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 5,700% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (2.377) | (2.376) |
| CCIRS | SEK 1.320.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,820% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 924 | 926 |
| CCIRS | SEK 710.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,832% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 463 | 463 |
| CCIRS | SEK 980.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,878% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 464 | 465 |
| CCIRS | SEK 1.320.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,900% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 512 | 511 |
| CCIRS | SEK 1.300.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,924% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 380 | 381 |
| CCIRS | SEK 690.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,933% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 384 | 179 |
| CCIRS | SEK 1.240.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 2,998% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 6 | 7 |
| CCIRS | SEK 550.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 3,010% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (24) | (24) |
| CCIRS | SEK 520.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 3,030% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (63) | (62) |
| CCIRS | SEK 280.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 3,050% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (55) | (56) |
| CCIRS | SEK 260.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 3,076% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (78) | (78) |
| CCIRS | SGD 35.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,750% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 148 | 148 |
| CCIRS | SGD 35.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,770% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 126 | 126 |
| CCIRS | USD 1.800.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 2,862% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2053 | 78.514 | 102.687 |
| CCIRS | USD 3.800.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,085% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2028 | 43.049 | 67.831 |
| CCIRS | USD 50.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,232% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 321 | 322 |
| CCIRS | USD 70.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,317% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 173 | 200 |
| CCIRS | USD 8.450.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,353% | Bank of America Merrill Lynch | 10/3/2027 | (17.056) | (27.133) |
| CCIRS | USD 490.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,454% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 4.171 | 4.544 |
| CCIRS | USD 440.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,512% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2026 | 3.445 | 3.406 |
| CCIRS | USD 2.010.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,639% | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2026 | 12.372 | 12.387 |
| CCIRS | USD 18.000.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 4,742% | Bank of America Merrill Lynch | 12/5/2024 | 51.178 | 51.640 |
| CCIRS | ZAR 3.922.000 | Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 8,205% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2024 | 1.432 | 1.433 |
| CDS | USD 700.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Lowe's Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2025 | 2.300 | 11.264 |
| CDS | USD 700.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on NextEra Energy Capital Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2024 | (527) | 4.675 |
| CDS | EUR 30.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Stena AB | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (292) | 416 |
| CDS | EUR 20.000 | Fund receives default protection on Altice France SA and pays Fixed 5,000% | Barclays Bank | 20/12/2027 | 1.576 | 3.076 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-------------|---|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | USD 26.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (492) | (141) |
| CDS | USD 25.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (473) | (135) |
| CDS | USD 30.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (568) | (162) |
| CDS | USD 24.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (448) | (130) |
| CDS | USD 30.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (560) | (162) |
| CDS | USD 16.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2024 | (299) | (87) |
| CDS | USD 12.000 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (273) | 546 |
| CDS | USD 63.857 | Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (1.452) | 2.907 |
| CDS | USD 112.334 | Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (2.663) | 7.968 |
| CDS | USD 35.503 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (43) | (523) |
| CDS | USD 53.255 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (66) | (784) |
| CDS | USD 35.503 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (44) | (523) |
| CDS | USD 284.468 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (370) | (4.190) |
| CDS | EUR 60.000 | Fund receives default protection on Eni SpA and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (61) | (450) |
| CDS | USD 326.221 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (1.155) | 2.209 |
| CDS | USD 86.949 | Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (1.000) | 565 |
| CDS | EUR 32.000 | Fund receives default protection on Solvay SA and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (318) | (310) |
| CDS | EUR 9.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Ladbrokes Group Finance Plc | Barclays Bank | 20/6/2028 | 12 | (499) |
| CDS | EUR 5.661 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Barclays Bank | 20/12/2027 | 382 | (1.061) |
| CDS | EUR 15.913 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Barclays Bank | 20/12/2027 | 1.075 | (2.983) |
| CDS | EUR 20.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA | Barclays Bank | 20/12/2025 | (1.165) | (1.590) |
| CDS | EUR 7.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | Barclays Bank | 20/6/2023 | (581) | (773) |
| CDS | EUR 50.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Telecom Italia SpA | Barclays Bank | 20/12/2024 | 230 | 2.285 |
| CDS | EUR 11.236 | Fund receives default protection on INEOS Group Holdings SA and pays Fixed 5,000% | BNP Paribas | 20/12/2027 | (43) | (1.135) |
| CDS | EUR 40.000 | Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo SpA and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/12/2027 | (889) | 2.165 |
| CDS | USD 258.704 | Fund receives default protection on Prudential Financial Inc and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/6/2028 | 39 | 1.104 |
| CDS | EUR 20.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on thyssenkrupp AG | BNP Paribas | 20/6/2023 | 477 | 2 |
| CDS | EUR 9.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | BNP Paribas | 20/12/2023 | (5.487) | (6.252) |
| CDS | EUR 32.000 | Fund receives default protection on Electricite de France SA and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2025 | (102) | (253) |
| CDS | EUR 4.618 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Citibank | 20/12/2027 | 347 | (866) |
| CDS | EUR 70.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/6/2027 | 3.221 | 6.282 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|--|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | USD 1.380.000 | Fund receives default protection on Comcast Corp and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2028 | (4.195) | (26.316) |
| CDS | USD 452.820 | Fund receives default protection on Dow Chemical Co and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2028 | (1.140) | 360 |
| CDS | EUR 50.000 | Fund receives default protection on BNP Paribas and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (986) | 933 |
| CDS | USD 71.481 | Fund receives default protection on Lincoln National Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (46) | 4.774 |
| CDS | USD 270.139 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | 168 | 1.829 |
| CDS | USD 108.056 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (23) | 732 |
| CDS | USD 108.056 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (23) | 732 |
| CDS | USD 268.476 | Fund receives default protection on Prudential Financial Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (505) | 1.146 |
| CDS | USD 214.781 | Fund receives default protection on Prudential Financial Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (232) | 916 |
| CDS | EUR 50.000 | Fund receives default protection on UBS AG and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (505) | (447) |
| CDS | EUR 40.000 | Fund receives default protection on UniCredit SpA and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2027 | (1.021) | 1.992 |
| CDS | EUR 50.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Credit Suisse Group Finance Guernsey Ltd | Goldman Sachs | 20/6/2028 | 1.157 | (525) |
| CDS | EUR 6.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | Goldman Sachs | 20/6/2023 | (48) | (663) |
| CDS | EUR 18.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | Goldman Sachs | 20/12/2027 | 78 | (2.150) |
| CDS | EUR 50.000 | Fund receives default protection on Aegon NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | 28 | (422) |
| CDS | EUR 40.000 | Fund receives default protection on Altice France SA and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/12/2027 | 2.952 | 6.152 |
| CDS | USD 1.640.000 | Fund receives default protection on Comcast Corp and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (12.460) | (31.275) |
| CDS | USD 177.514 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (364) | (2.615) |
| CDS | USD 88.757 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (106) | (1.307) |
| CDS | EUR 50.000 | Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | 5 | 939 |
| CDS | USD 108.056 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (383) | 732 |
| CDS | USD 162.083 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (232) | 1.097 |
| CDS | EUR 12.000 | Fund receives default protection on Monitchem HoldCo 3 SA and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | 799 | 219 |
| CDS | EUR 12.000 | Fund receives default protection on Monitchem HoldCo 3 SA and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | 743 | 219 |
| CDS | USD 268.476 | Fund receives default protection on Prudential Financial Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (1.074) | 1.146 |
| CDS | EUR 125.000 | Fund receives default protection on Solvay SA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (856) | (1.212) |
| CDS | EUR 37.000 | Fund receives default protection on UniCredit SpA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2027 | (622) | 1.842 |
| CDS | EUR 25.000 | Fund receives default protection on UniCredit SpA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (979) | 1.471 |
| CDS | USD 1.550.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Bank of America Corp | JP Morgan | 20/6/2028 | 9.134 | 2.688 |
| CDS | EUR 10.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Ladbrokes Group Finance Plc | JP Morgan | 20/6/2027 | 747 | (322) |
| CDS | EUR 30.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Ladbrokes Group Finance Plc | JP Morgan | 20/6/2027 | 2.609 | (966) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | USD 452.820 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Sherwin-Williams Co | JP Morgan | 20/6/2028 | 3.301 | 2.961 |
| CDS | EUR 8.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | JP Morgan | 20/12/2024 | 328 | (632) |
| CDS | EUR 9.663 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | JP Morgan | 20/12/2027 | 604 | (1.812) |
| CDS | EUR 40.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA | JP Morgan | 20/12/2025 | (2.279) | (3.180) |
| CDS | EUR 10.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | JP Morgan | 20/6/2028 | (260) | (7.285) |
| CDS | EUR 7.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | JP Morgan | 20/6/2028 | 185 | (5.100) |
| CDS | EUR 100.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Glencore Finance Europe Ltd | JP Morgan | 20/6/2028 | (221) | 13.935 |
| CDS | EUR 59.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | JP Morgan | 20/6/2028 | 3.054 | (4.174) |
| CDS | EUR 26.951 | Fund receives default protection on Naturgy Capital Markets SA and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | (358) | (408) |
| CDS | EUR 50.000 | Fund receives default protection on Solvay SA and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (200) | (485) |
| CDS | USD 27.000 | Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.9.BBB- | Morgan Stanley | 17/9/2058 | (1.450) | (6.061) |
| CDS | EUR 7.006 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Morgan Stanley | 20/12/2027 | 438 | (1.313) |
| CDS | EUR 190.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on EDP - Energias de Portugal SA | Morgan Stanley | 20/6/2023 | (5.772) | 488 |
| CDS | EUR 190.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Naturgy Capital Markets SA | Morgan Stanley | 20/6/2023 | 719 | 61 |
| IRS | BRL 403.879 | Fund receives Fixed 11,380% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Bank of America Merrill Lynch | 2/1/2026 | 1.029 | 1.029 |
| IRS | BRL 716.423 | Fund receives Fixed 11,865% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Bank of America Merrill Lynch | 2/1/2025 | 763 | 763 |
| IRS | BRL 670.480 | Fund receives Fixed 12,603% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Bank of America Merrill Lynch | 1/7/2024 | 278 | 278 |
| IRS | COP 350.674.000 | Fund receives Floating COP 12 Month IBRCOL and pays Fixed 11,895% | Bank of America Merrill Lynch | 19/10/2024 | 201 | 201 |
| IRS | BRL 493.000 | Fund receives Fixed 11,745% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Citibank | 2/1/2026 | 1.997 | 1.997 |
| IRS | BRL 519.572 | Fund receives Fixed 11,800% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Citibank | 2/1/2026 | 2.248 | 2.248 |
| IRS | BRL 714.344 | Fund receives Fixed 11,915% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Citibank | 2/1/2026 | 3.468 | 3.468 |
| IRS | BRL 418.001 | Fund receives Fixed 12,970% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Citibank | 1/7/2024 | 474 | 474 |
| IRS | COP 676.223.000 | Fund receives Floating COP 12 Month IBRCOL and pays Fixed 12,370% | Citibank | 18/4/2024 | 292 | 292 |
| IRS | BRL 252.783 | Fund receives Fixed 12,965% and pays Floating BRL 12 Month CETIP | Goldman Sachs | 1/7/2024 | 284 | 284 |
| TRS | EUR 1.325.000 | Fund receives 3 Month EURIBOR and pays Markit iBoxx EUR Liquid High Yield Index | BNP Paribas | 20/6/2023 | (16.788) | (16.788) |
| TRS | EUR 850.000 | Fund receives 3 Month EURIBOR and pays Markit iBoxx EUR Liquid High Yield Index | BNP Paribas | 20/6/2023 | (7.534) | (7.534) |
| TRS | EUR 670.000 | Fund receives 3 Month EURIBOR and pays Markit iBoxx EUR Liquid High Yield Index | JP Morgan | 20/6/2023 | (21.005) | (21.006) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|---------------|---|-------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| TRS | USD 5.000.000 | Fund receives 3 Month SOFR and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid Index | JP Morgan | 20/6/2023 | (60.131) | (60.082) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 379.079.761) | | | | | (1.507.770) | (1.843.099) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILs: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRs: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 CDS: Credit Default Swaps
 IRS: Zinsraten-Swaps
 TRS: Gesamtertrag-Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertrags- wahrung | Kontrakte/ Bezeichnung | Verfalls- datum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------------|---|--------------------|--|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (10) | USD | 3 Month SOFR Futures December 2023 | Marz 2024 | 2.228.987 | (15.102) |
| (14) | USD | 3 Month SOFR Futures September 2023 | Dezember 2023 | 3.109.600 | 25.818 |
| 4 | AUD | 90 Day Bank Bill Futures March 2024 | Marz 2024 | 2.403.455 | (1.027) |
| (4) | AUD | 90 Day Bank Bill Futures September 2023 | September 2023 | 2.402.634 | 997 |
| 5 | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 363.809 | (4.447) |
| (8) | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 582.095 | 3.072 |
| 1 | CAD | Canadian 10 Year Bond Futures September 2023 | September 2023 | 84.658 | (887) |
| (15) | CAD | Canadian 10 Year Bond Futures September 2023 | September 2023 | 1.269.864 | 15.332 |
| 16 | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.887.040 | (570) |
| (63) | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 7.430.220 | (10.630) |
| (13) | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.503.320 | (27.073) |
| 2 | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 271.420 | 1.380 |
| (22) | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 2.985.620 | (10.160) |
| (3) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 413.100 | 3.720 |
| 27 | EUR | Euro Schatz Futures June 2023 | Juni 2023 | 2.850.255 | (4.966) |
| (34) | EUR | Euro Schatz Futures June 2023 | Juni 2023 | 3.589.210 | (2.608) |
| (1) | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 42.480 | (1.445) |
| (14) | EUR | Euro-OAT Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.822.940 | 6.461 |
| (30) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 29.787.289 | (524.451) |
| 10 | KRW | Korea 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 792.918 | (16.194) |
| 1 | GBP | Three Month SONIA Index Futures December 2024 | Marz 2025 | 276.448 | (2.710) |
| 10 | GBP | Three Month SONIA Index Futures September 2023 | Dezember 2023 | 2.744.045 | (26.192) |
| 6 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 672.866 | (371) |
| (6) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 672.866 | 27.720 |
| 32 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 3.578.971 | 48.600 |
| (4) | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 447.371 | 1.125 |
| (2) | USD | US Long Bond Futures September 2023 | September 2023 | 239.756 | (2.251) |
| (84) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 9.463.769 | (57.205) |
| 49 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 5.250.923 | 9.489 |
| (18) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 1.928.910 | (4.825) |
| 37 | USD | US Treasury 2 Year Note Futures June 2023 | Juni 2023 | 7.092.625 | (6.772) |
| (37) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures June 2023 | Juni 2023 | 7.092.625 | 124.713 |
| 156 | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 30.085.525 | (10.015) |
| (2) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 385.712 | 380 |
| 45 | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 4.596.736 | (3.526) |
| (46) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 4.698.886 | (20.771) |
| (2) | USD | US Ultra Bond Futures September 2023 | September 2023 | 255.209 | (2.400) |
| Gesamt | | | | | (487.791) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|---|-------------------------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 21 | Put | EURO STOXX 50 Index | Bank of America Merrill Lynch | EUR 4.000,00 | 20/10/2023 | (102) | 633 |
| 42.000 | Call | OTC USD/CLP | Bank of America Merrill Lynch | USD 830,00 | 02/06/2023 | (793) | 18 |
| 17.790.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 123,25 | 06/06/2023 | (251.779) | 17 |
| 92.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 128,00 | 22/06/2023 | (266) | 18 |
| 300.000 | Put | S&P 500 Index & 3 Month SOFR Futures (Dual Digital) | Bank of America Merrill Lynch | USD 3.922,80 | 15/09/2023 | 227 | 25.568 |
| 690.000 | Put | S&P 500 Index & OTC EUR/USD (Dual Digital) | Bank of America Merrill Lynch | EUR 1,03 | 16/06/2023 | (56.689) | 3.341 |
| 2.080.000 | Call | OTC EUR/USD | Deutsche Bank | EUR 1,13 | 19/07/2023 | (12.143) | 657 |
| 32 | Put | DAX Index | Exchange Traded | EUR 14.500,00 | 16/06/2023 | (34.880) | 3.840 |
| 30 | Put | DAX Index | Exchange Traded | EUR 15.400,00 | 15/09/2023 | (53.487) | 54.000 |
| 1 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.550,00 | 16/06/2023 | (5.754) | 166 |
| 8 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.900,00 | 16/06/2023 | (22.695) | 4.720 |
| 1 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 3.850,00 | 16/06/2023 | (12.538) | 473 |
| 1 | Call | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 4.200,00 | 16/06/2023 | 928 | 4.702 |
| 1 | Call | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 4.000,00 | 16/06/2023 | 8.367 | 19.279 |
| 11 | Put | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 4.100,00 | 20/10/2023 | (35.266) | 121.255 |
| 6 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.250,00 | 16/06/2023 | 1.518 | 3.372 |
| 7 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.000,00 | 21/07/2023 | 580 | 2.492 |
| 57 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.250,00 | 20/10/2023 | (6.200) | 84.075 |
| 7 | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.300,00 | 21/07/2023 | 2.191 | 7.546 |
| 12 | Call | EURO STOXX Banks Index | Exchange Traded | EUR 110,00 | 16/06/2023 | (900) | 30 |
| 33 | Put | DAX Index | Goldman Sachs | EUR 14.400,00 | 21/07/2023 | (41.287) | 14.219 |
| 2.190.000 | Call | OTC EUR/USD | Goldman Sachs | EUR 1,14 | 16/06/2023 | (6.726) | 2 |
| 32.000 | Call | OTC USD/ZAR | Goldman Sachs | USD 19,75 | 17/07/2023 | 143 | 705 |
| 70.000 | Put | OTC USD/MXN | HSBC | USD 18,15 | 16/06/2023 | 706 | 1.770 |
| 34.000 | Put | OTC USD/MXN | HSBC | USD 17,70 | 10/07/2023 | (40) | 362 |
| 49.000 | Put | OTC USD/MXN | HSBC | USD 17,50 | 16/06/2023 | (30) | 175 |
| 32.000 | Put | OTC USD/TBH | JP Morgan | USD 34,25 | 22/06/2023 | (119) | 113 |
| 145.100 | Call | Topix Banks Index | JP Morgan | JPY 227,60 | 14/07/2023 | (7.855) | 1.479 |
| 82.000 | Put | OTC AUD/USD | Morgan Stanley | AUD 0,66 | 16/06/2023 | 401 | 929 |
| 48.000 | Put | OTC EUR/USD | Morgan Stanley | EUR 1,07 | 06/06/2023 | 70 | 178 |
| 60.000 | Put | OTC EUR/USD | Standard Chartered Bank | EUR 1,09 | 01/06/2023 | 853 | 1.162 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 7.108.013) | | | | | | (533.565) | 357.296 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------|------------------------|-------------------------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (42.000) | Call | OTC USD/CLP | Bank of America Merrill Lynch | USD 870,00 | 02/06/2023 | 355 | — |
| (42.000) | Put | OTC USD/CLP | Bank of America Merrill Lynch | USD 780,00 | 02/06/2023 | 381 | — |
| (17.790.000) | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 121,31 | 06/06/2023 | 192.499 | (17) |
| (2.080.000) | Call | OTC EUR/USD | Deutsche Bank | EUR 1,15 | 19/07/2023 | 4.520 | (110) |
| (32) | Put | DAX Index | Exchange Traded | EUR 13.000,00 | 16/06/2023 | 11.760 | (880) |
| (30) | Put | DAX Index | Exchange Traded | EUR 13.900,00 | 15/09/2023 | 31.475 | (20.625) |
| (30) | Call | DAX Index | Exchange Traded | EUR 16.700,00 | 15/09/2023 | 24.199 | (27.675) |
| (2) | Call | E-Mini S&P 500 Index | Exchange Traded | USD 4.100,00 | 16/06/2023 | (10.415) | (23.938) |
| (6) | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.075,00 | 16/06/2023 | (282) | (1.014) |
| (14) | Put | EURO STOXX 50 Index | Exchange Traded | EUR 4.150,00 | 21/07/2023 | (2.506) | (8.764) |
| (12) | Call | EURO STOXX Banks Index | Exchange Traded | EUR 120,00 | 16/06/2023 | 210 | (30) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|---------------------------------|-----------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (2) | Call | US Treasury 2 Year Note Futures | Exchange Traded | USD 103,00 | 23/06/2023 | (150) | (1.346) |
| (1) | Call | US Treasury 5 Year Note Futures | Exchange Traded | USD 110,00 | 23/06/2023 | 173 | (322) |
| (1) | Put | US Treasury 5 Year Note Futures | Exchange Traded | USD 109,00 | 23/06/2023 | (163) | (739) |
| (1) | Call | US Treasury 5 Year Note Futures | Exchange Traded | USD 109,25 | 23/06/2023 | (6) | (629) |
| (33) | Put | DAX Index | Goldman Sachs | EUR 13.400,00 | 21/07/2023 | 23.352 | (6.266) |
| (33) | Call | DAX Index | Goldman Sachs | EUR 16.700,00 | 21/07/2023 | 14.840 | (5.422) |
| (32.000) | Put | OTC USD/ZAR | Goldman Sachs | USD 19,00 | 17/07/2023 | 215 | (226) |
| (98.000) | Put | OTC USD/MXN | HSBC | USD 17,50 | 16/06/2023 | (31) | (351) |
| (22.000) | Call | OTC USD/MXN | HSBC | USD 18,50 | 10/07/2023 | 38 | (104) |
| (145.100) | Put | Topix Banks Index | JP Morgan | JPY 182,08 | 14/07/2023 | 6.132 | (2.551) |
| (62.000) | Call | OTC AUD/USD | Morgan Stanley | AUD 0,68 | 16/06/2023 | 381 | (5) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 2.579.559) | | | | | | 296.977 | (101.014) |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|--|----------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 640.000 | Call | Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed semi-annually from 10/7/2023; and pays Floating USD 12 Month SOFR annually from 12/7/2024 | Citibank | USD 3,00 | 10/07/2023 | (3.663) | 2.046 |
| 18.630.000 | Put | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG. 39 Version 1 from 19/7/2023; and provides 1% Fixed quarterly from 20/12/2022 | Goldman Sachs | USD 0,80 | 19/07/2023 | (63.373) | 23.117 |
| 2.478.500.000 | Put | Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY 12 Month TONA annually from 4/8/2024; and pays 0,5% Fixed annually from 2/8/2023 | JP Morgan | JPY 0,50 | 02/08/2023 | (35.598) | 120 |
| 2.743.000 | Put | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023; and provides 1% Fixed quarterly from 20/6/2022 | Morgan Stanley | EUR 0,93 | 21/06/2023 | (5.046) | 1.537 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 8.100.104) | | | | | | (107.680) | 26.820 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|--------------|---|---------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (53.330.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,9% Fixed semi-annually from 1/12/2023; and pays Floating USD 12 Month SOFR annually from 5/12/2024 | Citibank | USD 3,90 | 01/12/2023 | (60.552) | (379.681) |
| (10.420.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,7% Fixed annually from 14/6/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 14/6/2024 | Citibank | GBP 4,70 | 14/06/2023 | (15.561) | (77.860) |
| (1.666.694) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,7% Fixed annually from 14/6/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 14/6/2024 | Citibank | GBP 4,70 | 14/06/2023 | (2.791) | (12.454) |
| (1.323.405) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,7% Fixed annually from 14/6/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 14/6/2024 | Citibank | GBP 4,70 | 14/06/2023 | (2.216) | (9.889) |
| (27.080.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD 12 Month SOFR annually from 28/12/2024; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 26/12/2023 | Citibank | USD 2,75 | 26/12/2023 | 34.015 | (103.993) |
| (18.630.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/12/2022; and provides default protection on Markit CDX. NA.IG. 39 Version 1 from 19/7/2023 | Goldman Sachs | USD 1,00 | 19/07/2023 | 47.296 | (6.328) |
| (18.630.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/12/2022; and provides default protection on Markit CDX. NA.IG. 39 Version 1 from 19/7/2023 | Goldman Sachs | USD 1,10 | 19/07/2023 | 36.969 | (4.027) |
| (1.200.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,2% Fixed annually from 17/7/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 17/7/2024 | Barclays Bank | GBP 4,20 | 17/07/2023 | (15.388) | (21.679) |
| (7.820.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,2% Fixed annually from 17/7/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 17/7/2024 | Barclays Bank | GBP 4,20 | 17/07/2023 | (100.276) | (141.275) |
| (26.250.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD 12 Month SOFR annually from 19/1/2025; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 17/1/2024 | Citibank | USD 2,75 | 17/01/2024 | 24.340 | (113.563) |
| (12.995.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,35% Fixed semi-annually from 2/2/2024; and pays Floating USD 12 Month SOFR annually from 6/2/2025 | Deutsche Bank | USD 3,35 | 02/02/2024 | (80.408) | (151.891) |
| (12.995.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,45% Fixed semi-annually from 2/2/2024; and pays Floating USD 12 Month SOFR annually from 6/2/2025 | Barclays Bank | USD 3,45 | 02/02/2024 | (60.348) | (138.553) |
| (583.750) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed annually from 25/8/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 25/8/2024 | Citibank | GBP 4,75 | 25/08/2023 | (3.343) | (5.664) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|--------------|---|----------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (575.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed annually from 1/9/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 1/9/2024 | Citibank | GBP 5,00 | 01/09/2023 | (951) | (3.927) |
| (5.690.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD 12 Month SOFR annually from 25/3/2025; and pays 2,5% Fixed semi-annually from 21/3/2024 | JP Morgan | USD 2,50 | 21/03/2024 | 5.155 | (25.999) |
| (1.920.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD 12 Month SOFR annually from 25/3/2025; and pays 2,5% Fixed semi-annually from 21/3/2024 | JP Morgan | USD 2,50 | 21/03/2024 | 1.739 | (8.773) |
| (5.690.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD 12 Month SOFR annually from 25/3/2025; and pays 2,5% Fixed semi-annually from 21/3/2024 | JP Morgan | USD 2,50 | 21/03/2024 | 5.628 | (25.999) |
| (395.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 from 21/6/2023; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2023 | Citibank | EUR 4,25 | 21/06/2023 | 1.340 | (1.646) |
| (563.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA annually from 19/6/2024; and pays 3,2% Fixed annually from 19/6/2023 | Goldman Sachs | GBP 3,20 | 19/06/2023 | 4.961 | (283) |
| (1.298.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA annually from 19/6/2024; and pays 3,6% Fixed annually from 19/6/2023 | Barclays Bank | GBP 3,60 | 19/06/2023 | 6.480 | (288) |
| (220.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 from 19/7/2023; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 4,50 | 19/07/2023 | (372) | (2.575) |
| (73.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 from 19/7/2023; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 4,37 | 19/07/2023 | 10 | (647) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 77.677.256) | | | | | | (174.273) | (1.236.994) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|---------|---------|-----------|----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 34.000 | CAD | 30.763 | Royal Bank of Canada | 15/6/2023 | (519) |
| AUD | 80.000 | NZD | 85.560 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 527 |
| AUD | 980.000 | NZD | 1.050.635 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 5.043 |
| AUD | 66.000 | USD | 44.671 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2023 | (1.768) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|---------|---------|----------|----------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 80.000 | USD | 53.101 | Citibank | 21/6/2023 | (1.152) |
| AUD | 280.000 | USD | 187.092 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (5.192) |
| BRL | 131.804 | USD | 26.000 | BNP Paribas | 2/6/2023 | (28) |
| BRL | 119.520 | USD | 24.000 | Citibank | 2/6/2023 | (422) |
| BRL | 71.498 | USD | 14.000 | UBS | 2/6/2023 | 82 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| BRL | 210.196 | USD | 42.000 | BNP Paribas | 5/7/2023 | (750) |
| BRL | 105.725 | USD | 21.000 | Citibank | 5/7/2023 | (260) |
| CAD | 64.670 | EUR | 44.000 | Deutsche Bank | 15/6/2023 | 450 |
| CLP | 16.291.000 | USD | 20.000 | Bank of America Merrill Lynch | 6/6/2023 | 88 |
| CNH | 3.770.000 | USD | 556.223 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2023 | (25.076) |
| CNH | 950.000 | USD | 139.682 | Morgan Stanley | 15/6/2023 | (5.869) |
| COP | 137.119.200 | GBP | 24.000 | Morgan Stanley | 15/6/2023 | 1.284 |
| COP | 72.443.200 | USD | 16.000 | Citibank | 15/6/2023 | 398 |
| CZK | 1.665.588 | USD | 78.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2023 | (2.992) |
| EUR | 93.853 | AUD | 150.000 | UBS | 21/6/2023 | 2.871 |
| EUR | 123.123 | CAD | 180.000 | UBS | 21/6/2023 | (573) |
| EUR | 225.967 | GBP | 200.000 | Australia and New Zealand Banking | 21/6/2023 | (5.741) |
| EUR | 454.629 | GBP | 400.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (8.787) |
| EUR | 667.889 | GBP | 590.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (15.650) |
| EUR | 804.207 | GBP | 706.350 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (14.128) |
| EUR | 994.742 | GBP | 880.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (24.773) |
| EUR | 664.578 | GBP | 590.000 | Chartered Bank | 21/6/2023 | (18.961) |
| EUR | 38.145.295 | GBP | 33.980.000 | State Street Bank & Trust Company | 21/6/2023 | (1.221.919) |
| EUR | 1.030.337 | GBP | 910.000 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | (23.936) |
| EUR | 130.794 | HUF | 52.000.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (8.424) |
| EUR | 1.614.607 | JPY | 228.170.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 87.278 |
| EUR | 90.475 | JPY | 12.780.000 | HSBC | 21/6/2023 | 4.928 |
| EUR | 1.095.780 | NOK | 12.500.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 46.684 |
| EUR | 172.304 | NOK | 2.000.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 4.450 |
| EUR | 102.906 | NOK | 1.200.000 | HSBC | 21/6/2023 | 2.194 |
| EUR | 247.426 | NOK | 2.800.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 12.430 |
| EUR | 21.000 | PLN | 96.352 | Morgan Stanley | 15/6/2023 | (210) |
| EUR | 3.000 | PLN | 13.771 | UBS | 15/6/2023 | (31) |
| EUR | 669.126 | SEK | 7.580.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 16.068 |
| EUR | 106.666 | SEK | 1.200.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 3.280 |
| EUR | 30.000 | USD | 32.332 | Morgan Stanley | 8/6/2023 | (272) |
| EUR | 58.000 | USD | 62.672 | BNP Paribas | 15/6/2023 | (650) |
| EUR | 24.000 | USD | 26.324 | Citibank | 15/6/2023 | (635) |
| EUR | 38.000 | USD | 41.006 | JP Morgan | 15/6/2023 | (376) |
| EUR | 500.000 | USD | 547.751 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (12.425) |
| EUR | 719.378 | USD | 780.000 | Bank of New York Mellon | 21/6/2023 | (10.317) |
| EUR | 2.887.692 | USD | 3.130.121 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (40.557) |
| EUR | 2.278.515 | USD | 2.465.718 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (28.180) |
| EUR | 920.000 | USD | 985.091 | Citibank | 21/6/2023 | (1.558) |
| EUR | 930.000 | USD | 1.000.230 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (5.722) |
| EUR | 320.000 | USD | 349.555 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (7.011) |
| EUR | 494.089 | USD | 540.000 | HSBC | 21/6/2023 | (11.084) |
| EUR | 3.728.108 | USD | 4.086.652 | JP Morgan | 21/6/2023 | (94.983) |
| EUR | 1.090.000 | USD | 1.193.523 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (26.548) |
| EUR | 182.949 | USD | 200.000 | Royal Bank of Canada | 21/6/2023 | (4.152) |
| EUR | 470.000 | USD | 519.902 | Societe Generale | 21/6/2023 | (16.372) |
| EUR | 31.036.788 | USD | 33.009.000 | State Street Bank & Trust Company | 21/6/2023 | 156.643 |
| GBP | 190.000 | EUR | 214.114 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 6.009 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|---------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| GBP | 430.000 | EUR | 494.347 | Bank of New York Mellon | 21/6/2023 | 3.825 |
| GBP | 1.210.000 | EUR | 1.390.449 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 11.385 |
| GBP | 260.000 | EUR | 298.872 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 2.349 |
| GBP | 774.615 | EUR | 890.785 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 6.638 |
| GBP | 310.000 | EUR | 350.891 | HSBC | 21/6/2023 | 8.257 |
| GBP | 490.000 | EUR | 555.495 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 12.190 |
| GBP | 230.000 | EUR | 263.692 | Nomura International | 21/6/2023 | 2.772 |
| GBP | 430.000 | EUR | 484.634 | Royal Bank of Canada | 21/6/2023 | 13.539 |
| GBP | 660.000 | EUR | 746.955 | Societe Generale | 21/6/2023 | 17.682 |
| GBP | 4.160.000 | EUR | 4.741.507 | State Street Bank & Trust Company | 21/6/2023 | 78.023 |
| GBP | 1.040.000 | EUR | 1.191.106 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | 13.774 |
| GBP | 10.000 | USD | 12.609 | Morgan Stanley | 15/6/2023 | (211) |
| GBP | 820.000 | USD | 1.014.088 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 1.317 |
| GBP | 560.000 | USD | 684.701 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 8.241 |
| GBP | 420.000 | USD | 522.538 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (2.250) |
| GBP | 1.400.000 | USD | 1.711.381 | JP Morgan | 21/6/2023 | 20.948 |
| GBP | 720.000 | USD | 896.060 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (4.121) |
| GBP | 280.000 | USD | 337.929 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | 8.256 |
| HUF | 52.000.000 | EUR | 126.314 | UBS | 21/6/2023 | 12.904 |
| HUF | 7.692.190 | USD | 22.000 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2023 | 46 |
| HUF | 5.606.532 | USD | 16.000 | Citibank | 15/6/2023 | 66 |
| IDR | 2.150.000.000 | USD | 140.065 | Barclays Bank | 15/6/2023 | 3.146 |
| IDR | 1.735.915.800 | USD | 117.040 | HSBC | 15/6/2023 | (1.158) |
| INR | 5.600.000 | USD | 67.437 | Goldman Sachs | 15/6/2023 | 245 |
| INR | 5.600.000 | USD | 67.474 | Nomura International | 15/6/2023 | 211 |
| JPY | 3.244.029 | EUR | 22.000 | Deutsche Bank | 15/6/2023 | (298) |
| JPY | 28.300.000 | EUR | 194.913 | Royal Bank of Canada | 21/6/2023 | (5.478) |
| JPY | 120.000.000 | EUR | 841.020 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (37.762) |
| JPY | 5.373.380 | USD | 40.000 | Royal Bank of Canada | 15/6/2023 | (1.486) |
| JPY | 537.530 | USD | 4.000 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (147) |
| JPY | 159.300.000 | USD | 1.200.703 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (56.940) |
| JPY | 183.060.000 | USD | 1.364.148 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (50.800) |
| JPY | 265.000.000 | USD | 2.046.386 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (140.547) |
| JPY | 7.000.000 | USD | 50.736 | JP Morgan | 21/6/2023 | (608) |
| JPY | 145.700.000 | USD | 1.090.443 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (44.828) |
| KRW | 272.500.000 | USD | 211.093 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2023 | (4.934) |
| KRW | 272.500.000 | USD | 208.700 | BNP Paribas | 15/6/2023 | (2.694) |
| KRW | 23.743.170 | USD | 18.000 | Morgan Stanley | 15/6/2023 | (62) |
| MXN | 768.262 | GBP | 34.000 | UBS | 15/6/2023 | 1.168 |
| MXN | 161.334 | USD | 9.000 | BNP Paribas | 15/6/2023 | 96 |
| MXN | 161.330 | USD | 9.000 | Societe Generale | 15/6/2023 | 96 |
| MXN | 1.002.444 | USD | 55.140 | JP Morgan | 31/8/2023 | 523 |
| NOK | 700.000 | EUR | 61.397 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (2.648) |
| NOK | 2.200.000 | EUR | 191.602 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (6.960) |
| NOK | 4.900.000 | EUR | 426.596 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (15.350) |
| NOK | 10.550.000 | EUR | 938.181 | HSBC | 21/6/2023 | (52.745) |
| NOK | 2.200.000 | EUR | 193.787 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (9.147) |
| NOK | 110.320 | USD | 10.000 | Deutsche Bank | 15/6/2023 | (99) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 53.610 | TWD | 1.650.000 | HSBC | 15/6/2023 | (78) |
| USD | 84.000 | TWD | 2.560.804 | Citibank | 13/7/2023 | 434 |
| USD | 14.850 | ZAR | 287.454 | Bank of America Merrill Lynch | 15/6/2023 | 248 |
| USD | 29.150 | ZAR | 562.836 | BNP Paribas | 15/6/2023 | 552 |
| USD | 18.000 | ZAR | 338.580 | Citibank | 15/6/2023 | 768 |
| USD | 20.000 | ZAR | 370.225 | Morgan Stanley | 15/6/2023 | 1.136 |
| USD | 91.642 | ZAR | 1.697.764 | Morgan Stanley | 8/8/2023 | 5.563 |
| ZAR | 568.614 | EUR | 28.000 | Deutsche Bank | 15/6/2023 | (998) |
| ZAR | 386.128 | USD | 20.000 | Citibank | 15/6/2023 | (382) |
| ZAR | 310.222 | USD | 16.000 | UBS | 15/6/2023 | (242) |
| | | | | | | (760.407) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 142 | EUR | 145 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1 |
| EUR | 5 | CHF | 4 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| | | | | | | 1 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 237.130 | GBP | 206.137 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.741) |
| GBP | 2.399.183 | EUR | 2.747.131 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 33.047 |
| | | | | | | 31.306 |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 247.521 | SEK | 2.801.713 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 6.131 |
| SEK | 24.081.980 | EUR | 2.148.326 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (73.482) |
| | | | | | | (67.351) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 264.975 | USD | 287.112 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (3.716) |
| USD | 4.631.411 | EUR | 4.186.745 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 147.533 |
| | | | | | | 143.817 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 207.376.791) | | | | | | (652.634) |

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert EUR | In % des NAV |
|---|-------------------------------------|---------------|--------------|
| „To be announced“ Wertpapierkontrakte | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 711.000 | Fannie Mae or Freddie Mac 3,500 TBA | 606.789 | 0,64 |
| USD 1.100.000 | Fannie Mae or Freddie Mac 3,500 TBA | 939.136 | 0,98 |
| USD (1.800.000) | Fannie Mae or Freddie Mac 4,500 TBA | (1.624.481) | (1,70) |
| USD 2.281.000 | Fannie Mae or Freddie Mac 2,500 TBA | 1.812.824 | 1,90 |
| USD (2.396.000) | Fannie Mae or Freddie Mac 2,000 TBA | (1.830.240) | (1,92) |
| USD (592.000) | Fannie Mae or Freddie Mac 4,500 TBA | (533.711) | (0,56) |
| USD 893.000 | Ginnie Mae II pool 4,500 TBA | 809.157 | 0,85 |
| | | 179.474 | 0,19 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 11.401.875) | | 179.474 | 0,19 |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Finanzen | 21,90 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 16,42 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 9,39 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 6,89 |
| Versorger | 6,20 |
| Staatsanleihen | 5,61 |
| Kommunikation | 4,94 |
| Zyklische Konsumgüter | 4,87 |
| Energie | 4,28 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 3,58 |
| Industrie | 2,97 |
| Grundstoffe | 1,13 |
| Technologie | 0,56 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 0,56 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 89,30 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 10,70 |
| 100,00 | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---------------------------------------|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Vereinigte Staaten von Amerika <i>Fortsetzung</i> | | | |
| STAMMAKTIE | | | | 12.483 | PayPal Holdings Inc | 784.057 | 2,30 |
| | Brasilien | | | 2.073 | Thermo Fisher Scientific Inc | 1.043.258 | 3,06 |
| 79.188 | Banco do Brasil SA ADR | 693.291 | 2,04 | 9.969 | Walt Disney Co | 873.185 | 2,56 |
| | | 693.291 | 2,04 | 2.821 | WD-40 Co | 537.316 | 1,58 |
| | Kanada | | | 9.889 | Western Alliance Bancorp | 339.786 | 1,00 |
| 5.195 | Canadian National Railway Co | 587.105 | 1,72 | 9.619 | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | 432.567 | 1,27 |
| 23.090 | Suncor Energy Inc | 646.395 | 1,90 | 7.600 | Yum China Holdings Inc | 423.562 | 1,24 |
| | | 1.233.500 | 3,62 | | | 13.360.875 | 39,22 |
| | Kaimaninseln | | | Gesamt Stammaktien | | | |
| 25.015 | XP Inc 'A' | 448.269 | 1,32 | | | 29.142.165 | 85,55 |
| | | 448.269 | 1,32 | ANLEIHEN | | | |
| | Dänemark | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 3.200 | Novo Nordisk A/S 'B' | 512.807 | 1,51 | USD 2.000.000 | United States Treasury Bill 29/6/2023 (Zero Coupon) | 1.992.857 | 5,85 |
| | | 512.807 | 1,51 | | | 1.992.857 | 5,85 |
| | Deutschland | | | Gesamt Anleihen | | | |
| 9.976 | Beiersdorf AG | 1.278.757 | 3,75 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| 2.262 | MTU Aero Engines AG | 525.075 | 1,54 | | | 31.135.022 | 91,40 |
| 7.226 | Symrise AG | 779.272 | 2,29 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | | 2.583.104 | 7,58 | Irland | | | |
| | Italien | | | 22.519 | BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist)* | 2.252.524 | 6,61 |
| 260.231 | Intesa Sanpaolo SpA | 603.099 | 1,77 | | | 2.252.524 | 6,61 |
| 21.476 | UniCredit SpA | 416.243 | 1,22 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | | 1.019.342 | 2,99 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| | Japan | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| 9.700 | Daiichi Sankyo Co Ltd | 314.187 | 0,92 | | | 677.147 | 1,99 |
| 35.000 | Makita Corp | 943.887 | 2,77 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | |
| 13.000 | NIDEC CORP | 643.670 | 1,89 | | | 34.064.693 | 100,00 |
| 43.000 | Recruit Holdings Co Ltd | 1.316.092 | 3,86 | | | | |
| 25.100 | Renesas Electronics Corp | 410.081 | 1,21 | | | | |
| 17.100 | Sony Group Corp | 1.605.508 | 4,71 | | | | |
| | | 5.233.425 | 15,36 | | | | |
| | Niederlande | | | | | | |
| 903 | ASML Holding NV | 652.652 | 1,92 | | | | |
| 7.473 | Heineken NV | 752.288 | 2,21 | | | | |
| | | 1.404.940 | 4,13 | | | | |
| | Schweden | | | | | | |
| 18.614 | Epiroc AB 'A' | 324.945 | 0,95 | | | | |
| | | 324.945 | 0,95 | | | | |
| | Schweiz | | | | | | |
| 9.895 | DSM-Firmenich AG | 1.086.122 | 3,19 | | | | |
| 1.163 | Lonza Group AG Reg | 726.102 | 2,13 | | | | |
| 27.247 | UBS Group AG RegS | 515.443 | 1,51 | | | | |
| | | 2.327.667 | 6,83 | | | | |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | |
| 7.934 | Amazon.com Inc | 966.203 | 2,84 | | | | |
| 12.312 | American International Group Inc | 665.217 | 1,95 | | | | |
| 23.581 | Baker Hughes Co | 646.827 | 1,90 | | | | |
| 8.658 | Black Knight Inc | 494.458 | 1,45 | | | | |
| 2.315 | Cadence Design Systems Inc | 540.159 | 1,58 | | | | |
| 4.412 | Chart Industries Inc | 487.614 | 1,43 | | | | |
| 13.208 | Citizens Financial Group Inc | 349.880 | 1,03 | | | | |
| 25.786 | Comcast Corp 'A' | 1.011.327 | 2,97 | | | | |
| 989 | Equinix Inc (REIT) | 731.158 | 2,15 | | | | |
| 12.875 | Freeport-McMoRan Inc | 431.956 | 1,27 | | | | |
| 6.428 | GE Healthcare Inc | 507.876 | 1,49 | | | | |
| 6.078 | General Electric Co | 612.176 | 1,80 | | | | |
| 11.904 | Match Group Inc | 409.498 | 1,20 | | | | |
| 2.056 | Meta Platforms Inc 'A' | 539.124 | 1,58 | | | | |
| 1.594 | Microsoft Corp | 533.671 | 1,57 | | | | |

* Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|--|---------------|---|---|---|---------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (37.548) | AT&T Inc | Goldman Sachs | 46.184 |
| Kanada | | | | (4.419) | Belden Inc | UBS | (21.741) |
| (8.121) | BCE Inc | UBS | 14.310 | (17.777) | BRP Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 31.999 |
| | | | 14.310 | (2.925) | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | UBS | 512 |
| Dänemark | | | | (2.258) | Coinbase Global Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.303) |
| (2.877) | Pandora A/S | JP Morgan | 23.700 | (14.018) | Conagra Brands Inc | UBS | 28.316 |
| | | | 23.700 | (3.989) | Futu Holdings Ltd ADR | JP Morgan | 16.390 |
| Frankreich | | | | (2.304) | GoDaddy Inc 'A' | UBS | (2.627) |
| 2.992 | Air Liquide SA | Goldman Sachs | (12.076) | (3.878) | International Business Machines Corp | Goldman Sachs | (21.019) |
| (6.011) | Airbus SE | Goldman Sachs | (4.621) | (10.849) | Interpublic Group of Cos Inc | Goldman Sachs | (25.821) |
| (7.441) | ICADE (REIT) | Goldman Sachs | 25.265 | (394) | Intuit Inc | UBS | 6.414 |
| | | | 8.568 | (13.220) | Iron Mountain Inc (REIT) | UBS | 28.555 |
| Deutschland | | | | (1.403) | Kinsale Capital Group Inc | Goldman Sachs | 28.116 |
| (9.623) | Vonovia SE | UBS | 16.646 | (8.108) | Omnicom Group Inc | UBS | 12.730 |
| | | | 16.646 | (6.750) | Penske Automotive Group Inc | Goldman Sachs | 1.957 |
| Hongkong | | | | 20.036 | Pinterest Inc 'A' | JP Morgan | 46.584 |
| (524.000) | Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' | JP Morgan | 32.106 | (5.232) | Post Holdings Inc | UBS | 17.109 |
| | | | 32.106 | (4.677) | Progressive Corp | Goldman Sachs | 19.503 |
| Irland | | | | (5.815) | Robert Half International Inc | Goldman Sachs | 11.223 |
| (23.439) | Glanbia Plc | JP Morgan | 8.509 | (7.536) | Timken Co | UBS | 12.284 |
| | | | 8.509 | (5.420) | Trade Desk Inc 'A' | UBS | (31.328) |
| Japan | | | | (6.312) | Trupanion Inc | UBS | (9.405) |
| (9.100) | Dentsu Group Inc | Goldman Sachs | 31.163 | (2.027) | Wix.com Ltd | UBS | 4.905 |
| (6.500) | Secom Co Ltd | Goldman Sachs | 4.545 | (1.003) | WW Grainger Inc | UBS | 20.592 |
| (134.700) | Seven Bank Ltd | UBS | 3.844 | | | | 219.129 |
| (32.800) | SoftBank Corp | JP Morgan | 13.222 | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 21.848.284) | | | 515.093 |
| | | | 52.774 | | | | |
| Niederlande | | | | | | | |
| (3.147) | Basic-Fit NV | Goldman Sachs | 8.132 | | | | |
| (8.876) | Basic-Fit NV | JP Morgan | 34.687 | | | | |
| (7.651) | Randstad NV | UBS | 13.071 | | | | |
| | | | 55.890 | | | | |
| Norwegen | | | | | | | |
| (71.800) | Kahoot! ASA | JP Morgan | (37.969) | | | | |
| | | | (37.969) | | | | |
| Südkorea | | | | | | | |
| (923) | LG H&H Co Ltd | JP Morgan | 43.678 | | | | |
| 10.003 | Samsung Electronics Co Ltd | JP Morgan | (5.664) | | | | |
| | | | 38.014 | | | | |
| Spanien | | | | | | | |
| (13.665) | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | JP Morgan | 10.651 | | | | |
| (192.254) | Mapfre SA | JP Morgan | 1.027 | | | | |
| (107.290) | Telefonica SA | UBS | (3.895) | | | | |
| | | | 7.783 | | | | |
| Schweden | | | | | | | |
| (70.823) | Fastighets AB Balder 'B' | UBS | 26.910 | | | | |
| (133.664) | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | JP Morgan | 60.010 | | | | |
| | | | 86.920 | | | | |
| Großbritannien | | | | | | | |
| (16.106) | Bunzl Plc | Goldman Sachs | (1.196) | | | | |
| (16.726) | Burberry Group Plc | UBS | 77.437 | | | | |
| 78.866 | HSBC Holdings Plc | UBS | (17.378) | | | | |
| (5.434) | Keywords Studios Plc | JP Morgan | 23.359 | | | | |
| 92.295 | Melrose Industries Plc | Goldman Sachs | 8.725 | | | | |
| 4.852 | Rio Tinto Plc | JP Morgan | (13.034) | | | | |
| (47.912) | Sage Group Plc | UBS | (34.756) | | | | |
| 53.965 | Smith & Nephew Plc | UBS | (54.444) | | | | |
| | | | (11.287) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|--|---------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (11) | EUR | CAC 40 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 836.967 | 28.189 |
| (8) | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.677.600 | (119.672) |
| (190) | EUR | STOXX Europe 600 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 4.603.176 | (178.413) |
| (11) | JPY | Topix Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.668.462 | (172.850) |
| Gesamt | | | | | (442.746) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-------------|---------|---------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 493.084 | USD | 529.640 | HSBC | 16/6/2023 | (2.721) |
| EUR | 1.298.384 | USD | 1.423.981 | Royal Bank of Canada | 16/6/2023 | (36.505) |
| EUR | 592.810 | USD | 641.677 | Toronto Dominion Bank | 16/6/2023 | (8.190) |
| JPY | 331.047.484 | USD | 2.475.115 | Morgan Stanley | 16/6/2023 | (108.236) |
| USD | 1.319.665 | CAD | 1.765.385 | Toronto Dominion Bank | 16/6/2023 | 23.064 |
| USD | 1.319.793 | CHF | 1.171.873 | State Street Bank & Trust Company | 16/6/2023 | 33.707 |
| USD | 912.711 | DKK | 6.194.017 | State Street Bank & Trust Company | 16/6/2023 | 23.871 |
| USD | 9.139.721 | EUR | 8.331.535 | Bank of America Merrill Lynch | 16/6/2023 | 236.494 |
| USD | 7.517.950 | JPY | 1.011.530.495 | Royal Bank of Canada | 16/6/2023 | 285.846 |
| USD | 652.515 | JPY | 90.100.478 | Toronto Dominion Bank | 16/6/2023 | 8.327 |
| USD | 501.779 | SEK | 5.123.605 | Morgan Stanley | 16/6/2023 | 30.054 |
| | | | | | | 485.711 |

| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|------------|-----|------------|-----------------------------------|-----------|-----------|
| AUD | 21.864.233 | USD | 14.867.466 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (694.771) |
| USD | 79.813 | AUD | 117.759 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 3.480 |
| | | | | | | (691.291) |

| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|-------|-----|-------|-----------------------------------|-----------|-------|
| CHF | 4.711 | USD | 5.319 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (150) |
| USD | 28 | CHF | 25 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1 |
| | | | | | | (149) |

| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
|---|-------|-----|-------|-----------------------------------|-----------|-------|
| EUR | 8.491 | USD | 9.397 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (323) |
| USD | 52 | EUR | 46 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 2 |
| | | | | | | (321) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 1.263.424 | USD | 1.600.650 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (36.226) |
| USD | 59.628 | GBP | 47.839 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 393 |
| | | | | | | (35.833) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 41.524.541) | | | | | | (241.883) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 24,08 |
| Finanzen | 13,99 |
| Industrie | 12,10 |
| Kommunikation | 11,15 |
| Technologie | 7,73 |
| Grundstoffe | 6,75 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 6,61 |
| Zyklische Konsumgüter | 5,95 |
| Staatsanleihen | 5,85 |
| Energie | 3,80 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,01 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,99 |
| 100,00 | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIE UND VORZUGSAKTIE | | | | | | | |
| Belgien | | | | | | | |
| 186.798 | Azelis Group NV | 4.567.486 | 0,13 | 9.825 | Duolingo Inc | 1.493.400 | 0,04 |
| | | 4.567.486 | 0,13 | 106.157 | DuPont de Nemours Inc | 7.184.706 | 0,21 |
| Bermuda | | | | | | | |
| 174.295 | Axalta Coating Systems Ltd | 5.092.900 | 0,15 | 4.988 | Dutch Bros Inc 'A' | 141.759 | 0,00 |
| | | 5.092.900 | 0,15 | 827.112 | Elanco Animal Health Inc | 6.625.167 | 0,19 |
| Kanada | | | | | | | |
| 222.400 | Bombardier Inc 'B' | 8.797.704 | 0,26 | 50.745 | Enfusion Inc 'A' | 396.826 | 0,01 |
| 976.520 | GFL Environmental Inc [^] | 35.808.988 | 1,04 | 147.937 | EngageSmart Inc | 2.751.628 | 0,08 |
| 39.453 | Shopify Inc 'A' | 2.306.028 | 0,07 | 764.208 | Envista Holdings Corp [^] | 24.546.361 | 0,71 |
| | | 46.912.720 | 1,37 | 28.626 | Five9 Inc | 1.836.358 | 0,05 |
| Kaimaninseln | | | | | | | |
| 318.669 | ATRenew Inc ADR | 898.647 | 0,03 | 183.213 | ForgeRock Inc 'A' | 3.656.931 | 0,11 |
| 743.905 | GLOBALFOUNDRIES Inc [^] | 44.321.860 | 1,29 | 101.511 | Freshworks Inc 'A' | 1.530.786 | 0,05 |
| 79.498 | Gracell Biotechnologies Inc ADR | 224.979 | 0,01 | 39.668 | Gitlab Inc 'A' | 1.430.428 | 0,04 |
| 865.339 | Lufax Holding Ltd ADR [^] | 1.098.981 | 0,03 | 1.170.000 | Hertz Global Holdings Inc [^] | 18.275.400 | 0,53 |
| 486.309 | RLX Technology Inc ADR | 863.198 | 0,02 | 31.523 | Hexcel Corp [^] | 2.186.120 | 0,06 |
| 67.881 | Tuya Inc ADR | 138.477 | 0,00 | 2.170.208 | Howmet Aerospace Inc | 92.689.584 | 2,70 |
| | | 47.546.142 | 1,38 | 838.316 | Informatica Inc 'A' | 14.343.587 | 0,42 |
| Israel | | | | | | | |
| 15.777 | Riskified Ltd 'A' | 83.460 | 0,00 | 61.274 | Innovage Holding Corp | 382.350 | 0,01 |
| | | 83.460 | 0,00 | 96.646 | International Flavors & Fragrances Inc | 7.463.971 | 0,22 |
| Niederlande | | | | | | | |
| 16.611 | Akzo Nobel NV | 1.255.027 | 0,04 | 1.453.504 | Kenvue Inc [^] | 37.107.957 | 1,08 |
| 38.714 | Elastic NV | 2.818.379 | 0,08 | 64.182 | Keysight Technologies Inc | 10.449.471 | 0,30 |
| 479.513 | QIAGEN NV | 21.591.036 | 0,63 | 63.083 | Lattice Semiconductor Corp | 5.229.581 | 0,15 |
| | | 25.664.442 | 0,75 | 262.973 | Legalzoom.com Inc | 2.895.333 | 0,08 |
| Schweiz | | | | | | | |
| 165.723 | On Holding AG 'A' | 4.539.153 | 0,13 | 29.186 | Lyell Immunopharma Inc | 85.515 | 0,00 |
| | | 4.539.153 | 0,13 | 14.778 | Meta Platforms Inc 'A' | 3.875.087 | 0,11 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| 8.398 | 2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust (Pref) (Pref) | 9.783.418 | 0,28 | 10.004 | Netflix Inc | 3.943.577 | 0,12 |
| 62.929 | ACV Auctions Inc 'A' [^] | 1.086.784 | 0,03 | 414.509 | Olin Corp [^] | 19.917.157 | 0,58 |
| 682.370 | Arconic Corp [^] | 19.713.669 | 0,57 | 57.828 | ON24 Inc | 457.419 | 0,01 |
| 95.808 | ATI Inc [^] | 3.288.131 | 0,10 | 63.541 | QUALCOMM Inc | 7.211.903 | 0,21 |
| 526.568 | Atmus Filtration Technologies Inc | 11.379.134 | 0,33 | 93.863 | Remitly Global Inc [^] | 1.642.603 | 0,05 |
| 64.393 | Bath & Body Works Inc | 2.286.595 | 0,07 | 120.912 | Rivian Automotive Inc 'A' [^] | 1.779.825 | 0,05 |
| 14.687 | Boeing Co | 2.964.277 | 0,09 | 85.026 | Robinhood Markets Inc 'A' [^] | 763.533 | 0,02 |
| 4.948.145 | Brookdale Senior Living Inc | 16.823.693 | 0,49 | 27.731 | ROBLOX Corp 'A' | 1.119.500 | 0,03 |
| 173.000 | Brookdale Senior Living Inc (Pref) (Pref) | 9.072.985 | 0,26 | 1.570 | Root Inc 'A' | 7.395 | 0,00 |
| 689.834 | Caesars Entertainment Inc | 28.165.922 | 0,82 | 15.912 | Salesforce Inc | 3.506.687 | 0,10 |
| 22.594 | Carvana Co [^] | 291.463 | 0,01 | 6.175 | ServiceNow Inc | 3.367.475 | 0,10 |
| 299.853 | Catalent Inc | 10.926.643 | 0,32 | 22.856 | Sherwin-Williams Co | 5.170.713 | 0,15 |
| 25.403 | Charter Communications Inc 'A' [^] | 8.394.421 | 0,24 | 13.259 | Snowflake Inc 'A' | 2.194.365 | 0,06 |
| 26.110 | Cigna Group | 6.360.657 | 0,19 | 256.220 | Sotera Health Co [^] | 3.587.080 | 0,10 |
| 34.740 | Cloudflare Inc 'A' [^] | 2.345.297 | 0,07 | 197.374 | Sovos Brands Inc [^] | 3.686.946 | 0,11 |
| 2.602 | ContextLogic Inc 'A' [^] | 19.359 | 0,00 | 467.511 | Sterling Check Corp [^] | 6.185.171 | 0,18 |
| 5.570.250 | Coty Inc 'A' [^] | 59.685.229 | 1,74 | 77.568 | Sweetgreen Inc 'A' [^] | 726.036 | 0,02 |
| 19.453 | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | 3.118.510 | 0,09 | 23.281 | Talis Biomedical Corp | 11.629 | 0,00 |
| 202.022 | Danaher Corp | 45.400.404 | 1,32 | 132.138 | Tenet Healthcare Corp | 9.199.448 | 0,27 |
| 322.735 | Definitive Healthcare Corp [^] | 3.149.894 | 0,09 | 166.685 | Thoughtworks Holding Inc [^] | 1.373.484 | 0,04 |
| 1.843.636 | DoubleVerify Holdings Inc [^] | 63.181.406 | 1,84 | 64.777 | T-Mobile US Inc | 8.915.259 | 0,26 |
| | | | | 66.501 | Toast Inc 'A' [^] | 1.439.082 | 0,04 |
| | | | | 34.056 | Unity Software Inc | 996.138 | 0,03 |
| | | | | 307.061 | Welltower Inc (REIT) [^] | 22.544.419 | 0,66 |
| | | | | 510.348 | WESCO International Inc (Pref) (Pref) | 13.667.119 | 0,40 |
| | | | | 3.790.800 | WeWork Inc 'A' | 706.226 | 0,02 |
| | | | | 14.465 | Workday Inc 'A' | 3.021.015 | 0,09 |
| | | | | 24.348 | Zoom Video Communications Inc 'A' | 1.601.124 | 0,05 |
| | | | | | | 682.758.525 | 19,85 |
| | | | | Gesamt Stammaktien und Vorzugsaktien | | 817.164.828 | 23,76 |
| | | | | ANLEIHEN | | | |
| | | | | Kanada | | | |
| | | | | USD 4.000.000 | Bank of Montreal/Chicago IL FRN 4/12/2023 | 3.999.686 | 0,12 |
| | | | | USD 7.125.000 | Bombardier Inc 7,50% 15/3/2025 | 7.144.330 | 0,21 |
| | | | | USD 22.016.000 | Bombardier Inc 7,125% 15/6/2026 | 21.691.350 | 0,63 |
| | | | | USD 3.968.000 | Bombardier Inc 6,00% 15/2/2028 | 3.687.353 | 0,11 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Kanada Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 3.777.000 | Canadian Solar Inc 2,50% 1/10/2025 | 4.952.591 | 0,14 | USD 10.000.000 | Federal Home Loan Bank Discount Notes 18/8/2023 (Zero Coupon) | 9.891.785 | 0,29 |
| | | 41.475.310 | 1,21 | USD 4.000.000 | Federal Home Loan Bank Discount Notes 25/8/2023 (Zero Coupon) | 3.952.852 | 0,12 |
| Chile | | | | USD 6.500.000 | Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc 4,625% 15/1/2029 | 5.630.348 | 0,16 |
| USD 16.333.000 | Latam Airlines Group SA 13,375% 15/10/2027 | 17.308.457 | 0,50 | USD 1.000.000 | Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc 6,75% 15/1/2030 | 807.041 | 0,02 |
| | | 17.308.457 | 0,50 | USD 7.500.000 | GrubHub Holdings Inc 5,50% 1/7/2027 | 4.944.813 | 0,14 |
| Indien | | | | USD 5.000.000 | Iris Holding Inc 10,00% 15/12/2028 | 3.750.000 | 0,11 |
| USD 7.000.000 | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd RegS 3,10% 2/2/2031^ | 4.947.215 | 0,14 | USD 38.000.000 | Michaels Cos Inc 7,875% 1/5/2029 | 23.526.940 | 0,68 |
| | | 4.947.215 | 0,14 | USD 2.707.000 | Middleby Corp 1,00% 1/9/2025 | 3.175.518 | 0,09 |
| Japan | | | | USD 4.500.000 | MoneyGram International Inc 5,375% 1/8/2026^ | 4.612.766 | 0,13 |
| USD 9.000.000 | Mizuho Bank Ltd FRN 5/9/2023 | 8.996.467 | 0,26 | USD 7.194.000 | Omniceil Inc 0,25% 15/9/2025 | 7.333.513 | 0,21 |
| | | 8.996.467 | 0,26 | USD 9.600.000 | Palo Alto Networks Inc 0,75% 1/7/2023 | 23.004.774 | 0,67 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | USD 1.462.000 | Peloton Interactive Inc 15/2/2026 (Zero Coupon) | 1.080.507 | 0,03 |
| USD 2.903.000 | ATI Inc 3,50% 15/6/2025 | 6.564.582 | 0,19 | USD 2.235.000 | Repay Holdings Corp 1/2/2026 (Zero Coupon) | 1.799.231 | 0,05 |
| USD 6.808.000 | Audacy Capital Corp 6,75% 31/3/2029 | 223.473 | 0,01 | USD 13.487.000 | RingCentral Inc 15/3/2026 (Zero Coupon) | 11.312.896 | 0,33 |
| USD 2.536.000 | Bentley Systems Inc 0,125% 15/1/2026 | 2.526.857 | 0,07 | USD 5.020.000 | Shift4 Payments Inc 15/12/2025 (Zero Coupon) | 5.314.275 | 0,15 |
| USD 12.564.000 | BILL Holdings Inc 1/12/2025 (Zero Coupon) | 12.496.062 | 0,36 | USD 3.252.000 | SoFi Technologies Inc 15/10/2026 (Zero Coupon) | 2.459.953 | 0,07 |
| USD 8.079.000 | Block Inc 0,25% 1/11/2027 | 6.230.802 | 0,18 | USD 4.013.000 | SolarEdge Technologies Inc 15/9/2025 (Zero Coupon) | 5.024.565 | 0,15 |
| USD 7.587.000 | Box Inc 15/1/2026 (Zero Coupon) | 9.287.718 | 0,27 | USD 29.530.000 | Sotheby's 7,375% 15/10/2027 | 26.376.556 | 0,77 |
| USD 18.588.000 | Brookdale Senior Living Inc 2,00% 15/10/2026 | 13.618.560 | 0,40 | USD 5.446.000 | Spotify USA Inc 15/3/2026 (Zero Coupon) | 4.667.451 | 0,14 |
| USD 18.875.000 | Bruce Mansfield Unit 1 6,85% 1/6/2034 | 2 | 0,00 | USD 36.769.000 | Staples Inc 7,50% 15/4/2026 | 30.310.646 | 0,88 |
| USD 14.824.000 | Caesars Entertainment Inc 6,25% 1/7/2025 | 14.808.503 | 0,43 | USD 25.934.000 | Staples Inc 10,75% 15/4/2027 | 15.957.037 | 0,46 |
| USD 10.660.000 | Caesars Entertainment Inc 8,125% 1/7/2027^ | 10.868.522 | 0,32 | USD 1.500.000 | Tenet Healthcare Corp 4,625% 15/7/2024 | 1.500.000 | 0,04 |
| USD 16.382.000 | Caesars Entertainment Inc 4,625% 15/10/2029^ | 14.152.574 | 0,41 | USD 13.767.000 | Tenet Healthcare Corp 4,25% 1/6/2029 | 12.404.903 | 0,36 |
| USD 20.000.000 | Carnival Holdings Bermuda Ltd 10,375% 1/5/2028 | 21.671.790 | 0,63 | USD 20.320.000 | T-Mobile USA Inc 2,625% 15/4/2026 | 18.932.652 | 0,55 |
| USD 7.778.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 7,375% 1/3/2031 | 7.445.529 | 0,22 | USD 61.500.000 | United States Treasury Bill 29/6/2023 (Zero Coupon) | 61.281.760 | 1,78 |
| USD 29.400.000 | Cengage Learning Inc 9,50% 15/6/2024 | 29.396.176 | 0,86 | USD 8.000.000 | United States Treasury Bill 3/8/2023 (Zero Coupon) | 7.928.278 | 0,23 |
| USD 7.879.000 | CHS/Community Health Systems Inc 5,625% 15/3/2027 | 6.771.041 | 0,20 | USD 3.500.000 | United States Treasury Bill 12/10/2023 (Zero Coupon) | 3.433.065 | 0,10 |
| USD 43.081.000 | Cloud Software Group Inc 6,50% 31/3/2029 | 38.290.673 | 1,11 | USD 15.000.000 | United States Treasury Bill 19/10/2023 (Zero Coupon) | 14.698.417 | 0,43 |
| USD 16.876.000 | Coinbase Global Inc 3,625% 1/10/2031 | 9.809.680 | 0,29 | USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 26/10/2023 (Zero Coupon) | 4.898.274 | 0,14 |
| USD 27.263.000 | Coty Inc 5,00% 15/4/2026 | 26.141.326 | 0,76 | USD 20.000.000 | United States Treasury Bill 9/11/2023 (Zero Coupon) | 19.549.602 | 0,57 |
| USD 7.000.000 | CSC Holdings LLC 5,25% 1/6/2024 | 6.501.903 | 0,19 | USD 10.000.000 | United States Treasury Bill 25/1/2024 (Zero Coupon) | 9.695.525 | 0,28 |
| USD 2.000.000 | Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co 5,375% 15/8/2026 | 89.990 | 0,00 | USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 22/2/2024 (Zero Coupon) | 4.831.755 | 0,14 |
| USD 22.000.000 | Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co 6,625% 15/8/2027 | 460.362 | 0,01 | USD 10.000.000 | United States Treasury Bill 21/3/2024 (Zero Coupon) | 9.603.223 | 0,28 |
| USD 15.250.000 | DISH Network Corp 11,75% 15/11/2027 | 14.736.958 | 0,43 | | | | |
| USD 12.333.000 | Envista Holdings Corp 2,375% 1/6/2025 | 19.616.884 | 0,57 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Schweden Fortsetzung | | | |
| USD 15.000.000 | United States Treasury Note/ Bond 2,25% 31/3/2024 | 14.632.622 | 0,43 | USD 6.316.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 25/10/2023 | 6.316.000 | 0,18 |
| USD 3.000.000 | United States Treasury Note/ Bond 2,50% 15/5/2024 | 2.923.729 | 0,09 | USD 4.000.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 6/11/2023 | 4.000.000 | 0,12 |
| USD 2.739.000 | Upwork Inc 0,25% 15/8/2026 | 2.185.606 | 0,06 | USD 5.000.000 | Swedbank AB FRN 2/11/2023 | 5.000.000 | 0,15 |
| USD 5.746.000 | Wayfair Inc 0,625% 1/10/2025 | 4.740.301 | 0,14 | | | 51.466.091 | 1,50 |
| USD 17.550.000 | WeWork Cos LLC RegS 11,00% 15/8/2027 | 8.511.750 | 0,25 | Großbritannien | | | |
| USD 13.797.031 | WeWork Cos LLC RegS 15,00% 15/8/2027 | 13.043.713 | 0,38 | USD 12.380.000 | Oversea Chinese Banking Corporation 5,28% 5/7/2023 | 12.380.000 | 0,36 |
| | | 681.438.609 | 19,81 | | | 12.380.000 | 0,36 |
| Gesamt Anleihen | | 754.166.058 | 21,92 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| EINLAGENZERTIFIKATE | | | | USD 4.597.000 | Bank of America NA FRN 6/2/2024 | 4.597.000 | 0,13 |
| Australien | | | | USD 4.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 2/2/2024 | 4.000.000 | 0,12 |
| USD 15.000.000 | Westpac Banking Corp FRN 6/11/2023 | 15.000.000 | 0,44 | USD 5.000.000 | HSBC Bank USA FRN 3/11/2023 | 5.000.000 | 0,14 |
| USD 10.000.000 | Westpac Banking Corp FRN 15/11/2023 | 10.000.000 | 0,29 | USD 10.000.000 | Natixis SA FRN 1/9/2023 | 10.000.000 | 0,29 |
| | | 25.000.000 | 0,73 | USD 10.000.000 | Natixis SA FRN 2/2/2024 | 10.000.000 | 0,29 |
| Kanada | | | | USD 10.000.000 | Nordea Bank Abp FRN 18/8/2023 | 10.000.000 | 0,29 |
| USD 24.400.000 | Bank of Montreal FRN 13/7/2023 | 24.400.000 | 0,71 | USD 5.000.000 | Nordea Bank Abp FRN 24/10/2023 | 5.000.000 | 0,15 |
| USD 15.000.000 | Bank of Montreal 5,40% 13/10/2023 | 15.000.000 | 0,43 | USD 14.000.000 | Standard Chartered Bank 5,29% 7/6/2023 | 14.000.064 | 0,41 |
| USD 15.000.000 | Bank of Nova Scotia FRN 13/12/2023 | 15.000.000 | 0,44 | USD 19.700.000 | Standard Chartered Bank 5,48% 28/7/2023 | 19.700.000 | 0,57 |
| USD 15.000.000 | Bank of Nova Scotia FRN 26/1/2024 | 15.000.000 | 0,44 | USD 15.810.000 | Standard Chartered Bank FRN 8/2/2024 | 15.810.000 | 0,46 |
| USD 10.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 5/6/2023 | 10.000.000 | 0,29 | USD 8.000.000 | Standard Chartered Bank FRN 1/3/2024 | 8.000.000 | 0,23 |
| USD 5.000.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 3/7/2023 | 5.000.000 | 0,14 | | | 106.107.064 | 3,08 |
| USD 15.000.000 | Royal Bank of Canada 4,08% 14/7/2023 | 15.000.000 | 0,44 | Gesamt Einlagenzertifikate | | 400.434.231 | 11,64 |
| USD 5.000.000 | Toronto-Dominion Bank FRN 6/2/2024 | 5.000.000 | 0,14 | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| | | 104.400.000 | 3,03 | Australien | | | |
| Frankreich | | | | USD 7.805.000 | ANZ New Zealand International Ltd 9/11/2023 (Zero Coupon) | 7.622.443 | 0,22 |
| USD 15.100.000 | BNP Paribas SA 4,12% 6/9/2023 | 15.100.000 | 0,44 | USD 4.606.000 | ANZ New Zealand International Ltd 15/11/2023 (Zero Coupon) | 4.497.244 | 0,13 |
| USD 1.500.000 | BNP Paribas SA FRN 16/11/2023 | 1.500.000 | 0,05 | USD 15.000.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd 1/12/2023 (Zero Coupon) | 14.599.688 | 0,43 |
| USD 15.486.000 | Credit Industriel Et Commercial SA FRN 19/7/2023 | 15.486.000 | 0,45 | USD 25.000.000 | Commonwealth Bank of Australia 13/7/2023 (Zero Coupon) | 25.000.000 | 0,73 |
| USD 9.000.000 | Natixis SA FRN 2/11/2023 | 8.995.336 | 0,26 | USD 2.000.000 | National Australia Bank Ltd FRN 15/11/2023 | 2.000.180 | 0,06 |
| USD 20.000.000 | Natixis SA FRN 8/12/2023 | 20.000.000 | 0,58 | USD 18.740.000 | Tesla Inc 9/6/2023 (Zero Coupon) | 18.717.262 | 0,54 |
| | | 61.081.336 | 1,78 | USD 47.720.000 | Tesla Inc 22/6/2023 (Zero Coupon) | 47.568.290 | 1,38 |
| Japan | | | | USD 15.000.000 | Westpac Banking Corp 6/5/2024 (Zero Coupon) | 14.252.000 | 0,41 |
| USD 3.000.000 | Mizuho Bank Ltd FRN 23/6/2023 | 3.000.000 | 0,09 | | | 134.257.107 | 3,90 |
| USD 10.000.000 | MUFG Bank Ltd FRN 15/6/2023 | 10.000.000 | 0,29 | Kanada | | | |
| USD 2.000.000 | MUFG Bank Ltd FRN 10/7/2023 | 1.999.740 | 0,06 | USD 5.000.000 | Bank of Nova Scotia 28/2/2024 (Zero Coupon) | 4.790.333 | 0,14 |
| USD 10.000.000 | MUFG Bank Ltd 5,30% 28/7/2023 | 10.000.000 | 0,29 | USD 4.250.000 | Bell Canada International Inc 22/6/2023 (Zero Coupon) | 4.236.910 | 0,12 |
| USD 15.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp FRN 16/8/2023 | 15.000.000 | 0,43 | USD 1.750.000 | CDP Financial Inc 13/6/2023 (Zero Coupon) | 1.747.078 | 0,05 |
| | | 39.999.740 | 1,16 | USD 15.000.000 | CDP Financial Inc 5/7/2023 (Zero Coupon) | 14.928.033 | 0,43 |
| Schweden | | | | USD 2.815.000 | CDP Financial Inc 20/7/2023 (Zero Coupon) | 2.795.996 | 0,08 |
| USD 2.300.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 17/7/2023 | 2.300.000 | 0,07 | USD 6.000.000 | CDP Financial Inc 24/7/2023 (Zero Coupon) | 5.954.773 | 0,17 |
| USD 9.100.000 | Svenska Handelsbanken AB 4,005% 15/8/2023 | 9.100.091 | 0,26 | | | | |
| USD 24.750.000 | Svenska Handelsbanken AB FRN 1/9/2023 | 24.750.000 | 0,72 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------------|---|------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Kanada Fortsetzung | | | | Niederlande | | | |
| USD 10.000.000 | CDP Financial Inc 17/11/2023 (Zero Coupon) | 9.753.542 | 0,28 | USD 15.000.000 | Unilever Finance International BV 27/11/2023 (Zero Coupon) | 14.608.438 | 0,42 |
| USD 7.000.000 | CDP Financial Inc 23/2/2024 (Zero Coupon) | 6.733.667 | 0,20 | | | 14.608.438 | 0,42 |
| USD 5.000.000 | John Deere Ltd 12/7/2023 (Zero Coupon) | 4.970.788 | 0,15 | Norwegen | | | |
| USD 5.000.000 | National Bank of Canada FRN 11/7/2023 | 5.000.000 | 0,15 | USD 5.000.000 | DNB Bank ASA 18/8/2023 (Zero Coupon) | 4.946.375 | 0,14 |
| USD 12.000.000 | Nutrien Ltd 6/6/2023 (Zero Coupon) | 11.991.200 | 0,35 | | | 4.946.375 | 0,14 |
| USD 14.500.000 | Nutrien Ltd 28/6/2023 (Zero Coupon) | 14.441.057 | 0,42 | Singapur | | | |
| USD 8.000.000 | Nutrien Ltd 30/6/2023 (Zero Coupon) | 7.965.522 | 0,23 | USD 5.803.000 | DBS Bank LTD 1/9/2023 (Zero Coupon) | 5.726.626 | 0,17 |
| USD 10.000.000 | TELUS Corp 1/6/2023 (Zero Coupon) | 10.000.000 | 0,29 | | | 5.726.626 | 0,17 |
| USD 10.750.000 | TELUS Corp 23/6/2023 (Zero Coupon) | 10.714.985 | 0,31 | Südafrika | | | |
| USD 15.000.000 | TELUS Corp 19/7/2023 (Zero Coupon) | 14.892.400 | 0,43 | USD 10.000.000 | KFW International Finance Inc 18/7/2023 (Zero Coupon) | 9.934.200 | 0,29 |
| USD 8.500.000 | TELUS Corp 24/7/2023 (Zero Coupon) | 8.432.050 | 0,25 | | | 9.934.200 | 0,29 |
| USD 2.862.000 | TELUS Corp 25/7/2023 (Zero Coupon) | 2.838.603 | 0,08 | Spanien | | | |
| USD 6.855.000 | TELUS Corp 28/7/2023 (Zero Coupon) | 6.796.173 | 0,20 | USD 2.000.000 | Banco Santander SA 12/6/2023 (Zero Coupon) | 1.997.054 | 0,06 |
| USD 5.000.000 | TELUS Corp 2/8/2023 (Zero Coupon) | 4.955.653 | 0,14 | USD 10.000.000 | Banco Santander SA 14/7/2023 (Zero Coupon) | 9.940.875 | 0,29 |
| USD 5.000.000 | TotalEnergies Capital SA 1/6/2023 (Zero Coupon) | 5.000.000 | 0,15 | USD 5.000.000 | Banco Santander SA 10/11/2023 (Zero Coupon) | 4.883.450 | 0,14 |
| | | 158.938.763 | 4,62 | | | 16.821.379 | 0,49 |
| Frankreich | | | | USD 15.000.000 | Nordea Bank Abp FRN 1/8/2023 | 15.000.000 | 0,44 |
| USD 10.000.000 | BPCE SA 1/8/2023 (Zero Coupon) | 9.916.294 | 0,29 | | | 15.000.000 | 0,44 |
| USD 10.000.000 | BPCE SA 7/12/2023 (Zero Coupon) | 9.731.200 | 0,28 | Großbritannien | | | |
| USD 10.000.000 | EssilorLuxottica SA 22/6/2023 (Zero Coupon) | 9.971.183 | 0,29 | USD 1.000.000 | Lloyds Bank Plc 17/7/2023 (Zero Coupon) | 993.611 | 0,03 |
| USD 30.000.000 | EssilorLuxottica SA 13/7/2023 (Zero Coupon) | 29.821.500 | 0,87 | USD 5.000.000 | Lloyds Bank Plc 31/8/2023 (Zero Coupon) | 4.936.805 | 0,15 |
| USD 12.297.000 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 9/2/2024 (Zero Coupon) | 11.857.984 | 0,35 | USD 5.000.000 | Lloyds Bank Plc 23/10/2023 (Zero Coupon) | 4.900.000 | 0,14 |
| USD 6.800.000 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 12/2/2024 (Zero Coupon) | 6.553.870 | 0,19 | USD 5.000.000 | Lloyds Bank Plc 10/11/2023 (Zero Coupon) | 4.884.125 | 0,14 |
| USD 8.124.000 | Natixis SA 1/9/2023 (Zero Coupon) | 8.016.872 | 0,23 | USD 1.000.000 | Standard Chartered Bank 7/8/2023 (Zero Coupon) | 990.676 | 0,03 |
| | | 85.868.903 | 2,50 | | | 16.705.217 | 0,49 |
| Deutschland | | | | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 3.250.000 | BASF SE 29/6/2023 (Zero Coupon) | 3.236.780 | 0,09 | USD 2.739.000 | ABN AMRO Bank NV 13/10/2023 (Zero Coupon) | 2.687.820 | 0,08 |
| USD 2.000.000 | BASF SE 30/6/2023 (Zero Coupon) | 1.991.574 | 0,06 | USD 5.340.000 | Amcor Finance USA Inc 1/6/2023 (Zero Coupon) | 5.340.000 | 0,16 |
| USD 15.000.000 | BASF SE 2/10/2023 (Zero Coupon) | 14.723.762 | 0,43 | USD 8.000.000 | Amcor Finance USA Inc 5/6/2023 (Zero Coupon) | 7.995.156 | 0,23 |
| USD 4.075.000 | BASF SE 18/12/2023 (Zero Coupon) | 3.952.524 | 0,11 | USD 15.865.000 | American Honda Finance Corp 3/8/2023 (Zero Coupon) | 15.713.688 | 0,46 |
| USD 12.750.000 | RWE AG 1/6/2023 (Zero Coupon) | 12.750.000 | 0,37 | USD 10.000.000 | AutoZone Inc 5/6/2023 (Zero Coupon) | 9.994.256 | 0,29 |
| USD 24.000.000 | RWE AG 7/6/2023 (Zero Coupon) | 23.977.800 | 0,70 | USD 15.000.000 | Barton Capital SA 1/9/2023 (Zero Coupon) | 14.800.667 | 0,43 |
| USD 5.000.000 | RWE AG 13/6/2023 (Zero Coupon) | 4.990.750 | 0,15 | USD 10.000.000 | Coca-Cola Co 18/7/2023 (Zero Coupon) | 9.936.028 | 0,29 |
| | | 65.623.190 | 1,91 | USD 7.500.000 | Coca-Cola Co 14/11/2023 (Zero Coupon) | 7.325.354 | 0,21 |
| Japan | | | | USD 20.000.000 | Coca-Cola Co 21/5/2024 (Zero Coupon) | 18.994.167 | 0,55 |
| USD 5.000.000 | MUFG Bank Ltd 22/8/2023 (Zero Coupon) | 4.942.258 | 0,14 | USD 7.140.000 | Collateralized Commercial Paper V Co LLC 10/8/2023 (Zero Coupon) | 7.070.861 | 0,21 |
| | | 4.942.258 | 0,14 | USD 1.250.000 | Columbia Funding Company LLC 8/6/2023 (Zero Coupon) | 1.248.773 | 0,04 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|----------------|--|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | |
| USD 3.000.000 | Estee Lauder Cos Inc 5/6/2023 (Zero Coupon) | 2.998.373 | 0,09 | USD 5.816.000 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 20/7/2023 (Zero Coupon) | 5.777.765 | 0,17 |
| USD 21.000.000 | Evergy Missouri West Inc 6/6/2023 (Zero Coupon) | 20.984.454 | 0,61 | USD 5.944.000 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 2/8/2023 (Zero Coupon) | 5.891.587 | 0,17 |
| USD 5.000.000 | Federation des Caisse Desjardins du Quebec 6/6/2023 (Zero Coupon) | 4.996.465 | 0,15 | USD 2.018.000 | Mackinac Funding Co LLC 1/8/2023 (Zero Coupon) | 2.001.074 | 0,06 |
| USD 31.950.000 | Fidelity National Information Services Inc 16/6/2023 (Zero Coupon) | 31.878.112 | 0,93 | USD 10.000.000 | Macquarie Bank Ltd 12/2/2024 (Zero Coupon) | 9.625.956 | 0,28 |
| USD 5.000.000 | FMS Wertmanagement 11/7/2023 (Zero Coupon) | 4.972.333 | 0,14 | USD 4.000.000 | Marriott International Inc 16/6/2023 (Zero Coupon) | 3.991.033 | 0,12 |
| USD 7.500.000 | FMS Wertmanagement 30/10/2023 (Zero Coupon) | 7.341.135 | 0,21 | USD 12.000.000 | Marriott International Inc 30/6/2023 (Zero Coupon) | 11.947.800 | 0,35 |
| USD 15.000.000 | GlaxoSmithKline LLC 14/8/2023 (Zero Coupon) | 14.841.208 | 0,43 | USD 5.980.000 | Marriott International Inc 14/7/2023 (Zero Coupon) | 5.941.215 | 0,17 |
| USD 21.250.000 | GlaxoSmithKline LLC 6/11/2023 (Zero Coupon) | 20.774.354 | 0,60 | USD 6.500.000 | Marriott International Inc 17/7/2023 (Zero Coupon) | 6.454.984 | 0,19 |
| USD 16.000.000 | GTA Funding LLC 26/6/2023 (Zero Coupon) | 15.944.667 | 0,46 | USD 10.000.000 | Mercedes-Benz Finance North America LLC 14/6/2023 (Zero Coupon) | 9.981.439 | 0,29 |
| USD 15.000.000 | GTA Funding LLC 27/6/2023 (Zero Coupon) | 14.944.642 | 0,43 | USD 3.250.000 | Mohawk Industries Inc 6/6/2023 (Zero Coupon) | 3.247.594 | 0,09 |
| USD 10.000.000 | Hewlett Packard Enterprise Co 31/7/2023 (Zero Coupon) | 9.909.500 | 0,29 | USD 7.500.000 | Mohawk Industries Inc 11/7/2023 (Zero Coupon) | 7.455.000 | 0,22 |
| USD 5.000.000 | Hitachi America Capital Ltd 1/6/2023 (Zero Coupon) | 5.000.000 | 0,15 | USD 7.571.000 | Mohawk Industries Inc 18/7/2023 (Zero Coupon) | 7.517.130 | 0,22 |
| USD 9.448.000 | Honeywell International Inc 23/6/2023 (Zero Coupon) | 9.419.131 | 0,27 | USD 11.750.000 | Mondelez International Inc 2/6/2023 (Zero Coupon) | 11.748.281 | 0,34 |
| USD 20.435.000 | Honeywell International Inc 26/6/2023 (Zero Coupon) | 20.365.464 | 0,59 | USD 9.000.000 | Mondelez International Inc 13/6/2023 (Zero Coupon) | 8.984.130 | 0,26 |
| USD 9.659.000 | Honeywell International Inc 27/6/2023 (Zero Coupon) | 9.624.120 | 0,28 | USD 21.000.000 | Nestle Finance International Ltd 29/9/2023 (Zero Coupon) | 20.643.350 | 0,60 |
| USD 2.941.000 | HSBC Bank USA 17/10/2023 (Zero Coupon) | 2.882.151 | 0,08 | USD 18.983.000 | NTT Finance Americas Inc 22/6/2023 (Zero Coupon) | 18.926.001 | 0,55 |
| USD 4.032.000 | HSBC Bank USA 1/11/2023 (Zero Coupon) | 3.943.235 | 0,11 | USD 3.000.000 | NTT Finance Americas Inc 13/7/2023 (Zero Coupon) | 2.981.940 | 0,09 |
| USD 19.715.000 | Hyundai Capital America 7/6/2023 (Zero Coupon) | 19.697.519 | 0,57 | USD 3.000.000 | Old Line Funding LLC 22/6/2023 (Zero Coupon) | 2.991.547 | 0,09 |
| USD 19.000.000 | Hyundai Capital America 20/6/2023 (Zero Coupon) | 18.946.826 | 0,55 | USD 7.250.000 | PPG Industries Inc 6/6/2023 (Zero Coupon) | 7.244.643 | 0,21 |
| USD 4.000.000 | ING US Funding LLC 22/8/2023 (Zero Coupon) | 3.955.082 | 0,12 | USD 15.000.000 | PPG Industries Inc 12/6/2023 (Zero Coupon) | 14.975.617 | 0,44 |
| USD 12.000.000 | ING US Funding LLC 22/8/2023 (Zero Coupon) | 11.861.420 | 0,35 | USD 2.000.000 | PPG Industries Inc 17/7/2023 (Zero Coupon) | 1.986.200 | 0,06 |
| USD 25.000.000 | John Deere Capital Corp 22/6/2023 (Zero Coupon) | 24.926.208 | 0,72 | USD 2.681.000 | Procter & Gamble Co 24/10/2023 (Zero Coupon) | 2.625.928 | 0,08 |
| USD 4.000.000 | Kenvue Inc 15/6/2023 (Zero Coupon) | 3.992.160 | 0,12 | USD 14.808.000 | Procter & Gamble Co 27/10/2023 (Zero Coupon) | 14.497.526 | 0,42 |
| USD 9.000.000 | Kenvue Inc 27/6/2023 (Zero Coupon) | 8.967.500 | 0,26 | USD 11.100.000 | Pure Grove Funding 12/6/2023 (Zero Coupon) | 11.082.770 | 0,32 |
| USD 6.250.000 | Keurig Dr Pepper Inc 1/6/2023 (Zero Coupon) | 6.250.000 | 0,18 | USD 5.000.000 | Salisbury Receivables Co LLC 2/8/2023 (Zero Coupon) | 4.956.944 | 0,14 |
| USD 30.000.000 | Koch Industries Inc 23/6/2023 (Zero Coupon) | 29.906.867 | 0,87 | USD 15.000.000 | Sherwin-Williams Co 10/7/2023 (Zero Coupon) | 14.912.250 | 0,43 |
| USD 3.000.000 | La Fayette Asset Securitization LLC 26/7/2023 (Zero Coupon) | 2.977.450 | 0,09 | USD 10.000.000 | Siemens Capital Co LLC 22/6/2023 (Zero Coupon) | 9.970.542 | 0,29 |
| USD 10.000.000 | LMA SA 10/8/2023 (Zero Coupon) | 9.902.972 | 0,29 | USD 20.000.000 | Societe Generale SA 12/2/2024 (Zero Coupon) | 19.264.711 | 0,56 |
| USD 5.000.000 | LMA SA 4/10/2023 (Zero Coupon) | 4.908.854 | 0,14 | USD 9.750.000 | Spire Inc 13/6/2023 (Zero Coupon) | 9.732.710 | 0,28 |
| USD 20.800.000 | L'Oreal SA 13/6/2023 (Zero Coupon) | 20.765.333 | 0,60 | USD 2.000.000 | Spire Inc 6/7/2023 (Zero Coupon) | 1.989.306 | 0,06 |
| USD 5.000.000 | L'Oreal SA 27/6/2023 (Zero Coupon) | 4.982.125 | 0,15 | USD 15.000.000 | Starbird Funding Corp 1/9/2023 (Zero Coupon) | 14.802.583 | 0,43 |
| USD 16.000.000 | L'Oreal SA 20/11/2023 (Zero Coupon) | 15.612.427 | 0,45 | USD 5.000.000 | Suncorp Metway Ltd 31/7/2023 (Zero Coupon) | 4.959.167 | 0,14 |
| USD 10.000.000 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 18/7/2023 (Zero Coupon) | 9.937.333 | 0,29 | USD 18.000.000 | TotalEnergies Capital SA 20/11/2023 (Zero Coupon) | 17.539.900 | 0,51 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| USD 5.000.000 | Toyota Industries Commercial Finance Inc 26/1/2024 (Zero Coupon) | 4.827.389 | 0,14 |
| USD 1.816.000 | Toyota Industries Commercial Finance Inc 5/2/2024 (Zero Coupon) | 1.753.197 | 0,05 |
| USD 5.000.000 | Toyota Motor Credit Corp 23/2/2024 (Zero Coupon) | 4.801.233 | 0,14 |
| USD 27.778.000 | Unilever Capital Corp 24/7/2023 (Zero Coupon) | 27.570.251 | 0,80 |
| USD 10.177.000 | Union Electric Co 8/6/2023 (Zero Coupon) | 10.166.413 | 0,30 |
| USD 5.000.000 | United Overseas Bank Ltd 25/7/2023 (Zero Coupon) | 4.961.000 | 0,14 |
| USD 4.159.000 | Versailles Commercial Paper LLC 5/6/2023 (Zero Coupon) | 4.156.708 | 0,12 |
| USD 22.000.000 | VW Credit Inc 12/6/2023 (Zero Coupon) | 21.964.171 | 0,64 |
| USD 3.740.000 | VW Credit Inc 27/6/2023 (Zero Coupon) | 3.725.279 | 0,11 |
| USD 30.000.000 | Walmart Inc 21/8/2023 (Zero Coupon) | 29.658.450 | 0,86 |
| | | 909.748.904 | 26,45 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 1.443.121.360 | 41,96 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 3.414.886.477 | 99,28 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| STAMMAKTIEN | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 476.486 | Escrow Altegrity Inc | 1.123.316 | 0,04 |
| 112.616 | Project Dvorak 'F' | 734.256 | 0,02 |
| | | 1.857.572 | 0,06 |
| Gesamt Stammaktien | | 1.857.572 | 0,06 |
| ANLEIHEN | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 3.835.625 | Bombardier Inc 16/6/2023 (Zero Coupon) | 3.797.268 | 0,11 |
| | | 3.797.268 | 0,11 |
| Gesamt Anleihen | | 3.797.268 | 0,11 |
| Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 5.654.840 | 0,17 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 3.420.541.317 | 99,45 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 19.059.010 | 0,55 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 3.439.600.327 | 100,00 |
| * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | |
| ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------------------|------------------------------------|------------------|---|---|--|----------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (449.255) | Extra Space Storage Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3.522.159 |
| Australien | | | | (20.176) | FedEx Corp | Citibank | 179.365 |
| 31.511 | Newcrest Mining Ltd | Citibank | (38.929) | (23.775) | FMC Corp | Morgan Stanley | 101.757 |
| 435.349 | Newcrest Mining Ltd | Morgan Stanley | (548.387) | 168.876 | Focus Financial Partners Inc 'A' | Barclays Bank | 5.066 |
| | | | (587.316) | 307.635 | Focus Financial Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 36.916 |
| Japan | | | | (155.773) | Freeport-McMoRan Inc (239) | Morgan Stanley | 322.450 |
| 2.332.809 | Toshiba Corp | Morgan Stanley | 183.077 | (24.143) | GE Healthcare Inc | Citibank | 55 |
| | | | 183.077 | (49.498) | General Electric Co | Citibank | 1.690 |
| Großbritannien | | | | (9.607) | Hologic Inc | Citibank | 189.577 |
| 220.526 | Dechra Pharmaceuticals Plc | Societe Generale | (797.128) | (23.037) | Honeywell International Inc | Citibank | 29.878 |
| 229.233 | EMIS Group Plc | Barclays Bank | 39.727 | 152.722 | Horizon Therapeutics Plc | Barclays Bank | 120.484 |
| 628.094 | EMIS Group Plc | BNP Paribas | (1.694.988) | 1.396.718 | Horizon Therapeutics Plc | JP Morgan | (164.940) |
| 537.101 | EMIS Group Plc | Societe Generale | (1.502.622) | 41.466 | Humana Inc | Morgan Stanley | (15.852.749) |
| 1.181.430 | Network International Holdings Plc | Societe Generale | (172.443) | (40.032) | Huntsman Corp | Morgan Stanley | (603.538) |
| | | | (4.127.454) | (20.659) | Illinois Tool Works Inc | Citibank | 63.651 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | (1.901) | Illumina Inc | Citibank | 162.173 |
| (23.141) | 3M Co | Citibank | 166.384 | 138.939 | International Flavors & Fragrances Inc | Morgan Stanley | 28.021 |
| 864.545 | Activision Blizzard Inc | JP Morgan | 4.193.043 | (64.191) | International Paper Co | Morgan Stanley | (857.254) |
| (41.826) | Advanced Micro Devices Inc | Citibank | (591.629) | 877.884 | IVERIC bio Inc | JP Morgan | 132.875 |
| (2.914) | Advanced Micro Devices Inc | Morgan Stanley | (41.219) | (67.657) | Kinder Morgan Inc | Citibank | 141.732 |
| (6.364) | Agilent Technologies Inc | Citibank | 87.060 | (6.698) | KLA Corp | Citibank | 28.416 |
| (16.567) | Air Products and Chemicals Inc | Morgan Stanley | 69.581 | (826) | KLA Corp | Morgan Stanley | (201.878) |
| (33.984) | Albemarle Corp | Morgan Stanley | 284.786 | (5.374) | Lam Research Corp | Citibank | (24.896) |
| 1.510.313 | Albertsons Cos Inc 'A' | JP Morgan | (830.672) | (408) | Lam Research Corp | Morgan Stanley | (220.818) |
| (12.461) | Analog Devices Inc | Citibank | 165.607 | 501.962 | Life Storage Inc (REIT) | Goldman Sachs | (17.765) |
| (2.766) | Analog Devices Inc | Morgan Stanley | 36.760 | (3.659) | Livent Corp | Morgan Stanley | (3.403.302) |
| (42.119) | Antero Midstream Corp | Citibank | 27.377 | (50.260) | LyondellBasell Industries NV 'A' | Morgan Stanley | 4.025 |
| (16.815) | Applied Materials Inc | Citibank | (135.865) | (10.242) | Martin Marietta Materials Inc | Morgan Stanley | 263.865 |
| (1.833) | Applied Materials Inc | Morgan Stanley | (14.811) | (2.436) | Mettler-Toledo International Inc | Morgan Stanley | 116.759 |
| 644.337 | Arconic Corp | Morgan Stanley | 6.443 | (648) | Mettler-Toledo International Inc | Citibank | 235.780 |
| (2.614) | ASML Holding NV Reg | Citibank | (67.546) | (13.421) | Microchip Technology Inc | Morgan Stanley | 62.720 |
| (274) | ASML Holding NV Reg | Morgan Stanley | (7.080) | (3.159) | Microchip Technology Inc | Citibank | 40.666 |
| (19.283) | Avery Dennison Corp | Morgan Stanley | 186.274 | (10.792) | Micron Technology Inc | Morgan Stanley | 9.572 |
| (37.713) | Ball Corp | Morgan Stanley | 114.648 | (2.637) | Micron Technology Inc | Citibank | (26.225) |
| (2.532) | Becton Dickinson & Co | Citibank | 30.916 | (14.942) | Middleby Corp | Morgan Stanley | (6.408) |
| (20.325) | Bentley Systems Inc 'B' | JP Morgan | (127.154) | (2.084) | MKS Instruments Inc | Citibank | 127.455 |
| (16.731) | Berry Global Group Inc | Morgan Stanley | 33.127 | (550) | MKS Instruments Inc | Morgan Stanley | (16.401) |
| (40.344) | BILL Holdings Inc | JP Morgan | (105.621) | (958) | Monolithic Power Systems Inc | Morgan Stanley | (4.329) |
| (1.270) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Citibank | 17.926 | (209) | Monolithic Power Systems Inc | Citibank | (60.929) |
| (3.946) | Block Inc | JP Morgan | (7.486) | (122.569) | Mosaic Co | Morgan Stanley | (13.292) |
| (21.053) | Boeing Co | Citibank | 85.896 | 258.277 | National Instruments Corp | Morgan Stanley | 422.863 |
| (232.062) | Box Inc 'A' | JP Morgan | (390.340) | (12.604) | Newmont Corp | JP Morgan | (43.907) |
| (62.387) | Broadcom Inc | JP Morgan | (10.988.846) | (223.818) | Newmont Corp | Citibank | 40.333 |
| (13.727) | Bruker Corp | Citibank | 89.088 | (50.790) | Nucor Corp | Morgan Stanley | 716.218 |
| (80.959) | Canadian Solar Inc | JP Morgan | (378.278) | 111.021 | NXP Semiconductors NV | Morgan Stanley | 500.282 |
| (6.740) | Carrier Global Corp | Citibank | 9.301 | 4.428 | Olin Corp | JP Morgan | 1.432.171 |
| 63.460 | Carrier Global Corp | Morgan Stanley | (87.575) | (38.290) | Omniceil Inc | Morgan Stanley | (26.745) |
| (24.359) | Caterpillar Inc | Citibank | 173.192 | (8.796) | ON Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (31.398) |
| (8.023) | Celanese Corp | Morgan Stanley | 29.525 | (2.782) | ON Semiconductor Corp | Citibank | 13.238 |
| 74.153 | Cigna Group | Morgan Stanley | (883.162) | (2.862) | Otis Worldwide Corp | Morgan Stanley | 4.187 |
| 335.344 | Corteva Inc | Morgan Stanley | (1.016.092) | 45.109 | Otis Worldwide Corp | Citibank | 11.992 |
| (20.968) | Cummins Inc | Citibank | 290.197 | (108.778) | Palo Alto Networks Inc | JP Morgan | (189.007) |
| 5.589 | Danaher Corp | Morgan Stanley | (36.608) | (30) | Peloton Interactive Inc 'A' | JP Morgan | (2.485.982) |
| (17.394) | Deere & Co | Citibank | 210.815 | (5.043) | Phillips 66 | Citibank | 32 |
| 88.232 | Dow Inc | Morgan Stanley | (268.225) | (33.112) | PPG Industries Inc | Morgan Stanley | 18.558 |
| 489.764 | DuPont de Nemours Inc | Morgan Stanley | 293.858 | 157.870 | Prometheus Biosciences Inc | Barclays Bank | 289.399 |
| (41.216) | Eastman Chemical Co | Morgan Stanley | 196.188 | 298.428 | Prometheus Biosciences Inc | JP Morgan | 806.716 |
| (17.247) | Ecolab Inc | Morgan Stanley | 149.531 | (4.424) | Qorvo Inc | Citibank | 1.295.178 |
| 12.928 | Elevance Health Inc | Citibank | (160.695) | (481) | Qorvo Inc | Morgan Stanley | (9.313) |
| 54.707 | Elevance Health Inc | Morgan Stanley | (680.008) | | | | (1.013) |
| (511) | Embecka Corp | Citibank | (92) | | | | |
| (75.401) | Emerson Electric Co | Citibank | 347.599 | | | | |
| (34.682) | Enbridge Inc | Citibank | 50.983 | | | | |
| (439.625) | Envista Holdings Corp | Morgan Stanley | 1.591.442 | | | | |
| (49.075) | Equitrans Midstream Corp | Citibank | (121.215) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|---|----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 921.325 | Qualtrics International Inc 'A' | Goldman Sachs | 92.133 |
| (3.862) | Repay Holdings Corp | JP Morgan | 541 |
| (59.980) | Republic Services Inc | Morgan Stanley | 113.962 |
| (405) | Resideo Technologies Inc | Citibank | 377 |
| (5.136) | Revvity Inc | Citibank | 26.245 |
| (317) | RingCentral Inc 'A' | JP Morgan | (2.596) |
| (16.307) | Rockwell Automation Inc | Citibank | 15.981 |
| 616.380 | Seagen Inc | JP Morgan | (1.990.907) |
| (60.614) | Sealed Air Corp | Morgan Stanley | 226.696 |
| (38.552) | Shift4 Payments Inc 'A' | Morgan Stanley | 143.413 |
| (4.897) | Skyworks Solutions Inc | Citibank | (8.815) |
| (1.009) | Skyworks Solutions Inc | Morgan Stanley | (1.816) |
| (30.182) | SoFi Technologies Inc | JP Morgan | (37.219) |
| (10.793) | SolarEdge Technologies Inc | Morgan Stanley | 120.450 |
| (1.009) | Spotify Technology SA | JP Morgan | (3.602) |
| (22.195) | Stanley Black & Decker Inc | Citibank | 110.753 |
| (2.048) | Sylvamo Corp | Morgan Stanley | 1.884 |
| 371.770 | Syneos Health Inc | Barclays Bank | (26.024) |
| 673.214 | Syneos Health Inc | JP Morgan | (132.596) |
| (17.794) | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | Citibank | (138.437) |
| (716) | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | Morgan Stanley | (5.570) |
| (8.420) | Teradyne Inc | Citibank | (31.996) |
| (378) | Teradyne Inc | Morgan Stanley | (1.436) |
| (5.440) | Texas Instruments Inc | Citibank | (20.291) |
| (1.300) | Texas Instruments Inc | Morgan Stanley | (4.849) |
| (1.504) | Thermo Fisher Scientific Inc | Citibank | 38.743 |
| 1.788.752 | Tower Semiconductor Ltd | JP Morgan | (3.899.479) |
| (20.369) | Union Pacific Corp | Citibank | 112.437 |
| (26.659) | United Parcel Service Inc 'B' | Citibank | 107.169 |
| (16.429) | UnitedHealth Group Inc | Morgan Stanley | 33.351 |
| (3.147) | Upwork Inc | JP Morgan | 802 |
| 600.191 | VMware Inc 'A' | JP Morgan | 7.274.315 |
| (19.667) | Vulcan Materials Co | Morgan Stanley | 47.201 |
| (56.396) | Waste Management Inc | Morgan Stanley | 120.123 |
| (359) | Waters Corp | Citibank | 6.196 |
| (1.692) | Waters Corp | Morgan Stanley | 29.204 |
| (174) | Wayfair Inc 'A' | JP Morgan | (52) |
| (102) | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Citibank | 579 |
| (60.428) | Westrock Co | Morgan Stanley | (604) |
| 284.827 | Williams Cos Inc | Citibank | (213.620) |
| | | | (18.682.841) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 1.510.807.865) | | | (23.214.534) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Netto(-verlust) USD | Marktwert USD |
|--|----------------|---|----------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 59.625.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.40 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (718.105) | (657.228) |
| CCCDs | USD 81.600.000 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.40 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (605.099) | (916.307) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 143.472.973) | | | | | (1.323.204) | (1.573.535) |
| CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps | | | | | | |

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Netto(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|---------------|---|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (1.506) | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 315.808.200 | (15.067.221) |
| (69) | USD | NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 19.842.330 | (2.750.405) |
| Gesamt | | | | | (17.817.626) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------|---------|---------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf BRL lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| BRL | 192.546.013 | USD | 38.090.947 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2023 | (151.967) |
| BRL | 168.874.574 | USD | 33.295.969 | State Street Bank & Trust Company | 5/7/2023 | (197.519) |
| USD | 38.226.772 | BRL | 192.546.012 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2023 | 287.792 |
| USD | 205.000 | BRL | 1.043.481 | State Street Bank & Trust Company | 5/7/2023 | 484 |
| | | | | | | (61.210) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 61.504.635 | USD | 69.455.964 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.965.000) |
| USD | 3.749.812 | CHF | 3.361.671 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 60.947 |
| | | | | | | (1.904.053) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 1.552.286.882 | USD | 1.717.833.123 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (59.131.342) |
| USD | 133.460.768 | EUR | 123.185.323 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1.830.639 |
| | | | | | | (57.300.703) |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 763.026.843 | USD | 966.832.575 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (22.020.333) |
| USD | 21.870.266 | GBP | 17.542.309 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 148.632 |
| | | | | | | (21.871.701) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|---------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf HKD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| HKD | 40.816 | USD | 5.208 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 4 |
| USD | 82 | HKD | 641 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| | | | | | | 4 |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| JPY | 3.201.820.225 | USD | 23.821.679 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (933.326) |
| USD | 1.060.580 | JPY | 142.822.809 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 39.605 |
| | | | | | | (893.721) |
| Auf SGD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SGD | 2.452.125 | USD | 1.853.758 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (41.882) |
| USD | 95.321 | SGD | 127.314 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1.248 |
| | | | | | | (40.634) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 2.963.047.099) | | | | | | (82.072.018) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Event Driven Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023 Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|-----------------|
| Finanzen | 25,24 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 20,19 |
| Zyklische Konsumgüter | 14,74 |
| Technologie | 10,28 |
| Industrie | 9,60 |
| Grundstoffe | 5,82 |
| Kommunikation | 5,28 |
| Staatsanleihen | 4,88 |
| Versorger | 2,47 |
| Energie | 0,95 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 0,00 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,45 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,55 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|---------------------------------------|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIE | | | | | | | |
| Australien | | | | Portugal | | | |
| 1.444.219 | APA Group (Unit) | 9.394.524 | 0,97 | 5.208.652 | EDP - Energias de Portugal SA | 25.338.363 | 2,61 |
| 1.649.250 | Dexus (REIT) | 8.772.788 | 0,90 | 2.383.126 | REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA | 6.412.347 | 0,66 |
| 17.680.883 | GDI Property Group Partnership (REIT) | 8.076.088 | 0,83 | | | 31.750.710 | 3,27 |
| 1.848.242 | Goodman Group (REIT) | 23.506.455 | 2,42 | Singapur | | | |
| 4.466.949 | GPT Group (REIT) | 12.126.431 | 1,25 | 3.737.100 | NetLink NBN Trust (Unit) | 2.387.791 | 0,25 |
| 12.485.110 | National Storage (REIT)^ | 20.384.540 | 2,10 | | | 2.387.791 | 0,25 |
| 1.587.725 | NEXTDC Ltd^ | 13.074.612 | 1,35 | Spanien | | | |
| 2.750.407 | Region RE Ltd (REIT)^ | 4.472.792 | 0,46 | 488.218 | Cellnex Telecom SA^ | 19.903.031 | 2,05 |
| 2.346.053 | Transurban Group (Unit) | 22.556.916 | 2,33 | 380.914 | EDP Renovaveis SA | 7.583.310 | 0,78 |
| | | 122.365.146 | 12,61 | | | 27.486.341 | 2,83 |
| Belgien | | | | Thailand | | | |
| 149.159 | Aedifica SA (REIT) | 9.993.847 | 1,03 | 2.350.700 | Airports of Thailand PCL NVDR | 4.779.081 | 0,49 |
| 136.695 | VGP NV | 13.457.148 | 1,38 | | | 4.779.081 | 0,49 |
| 74.497 | Warehouses De Pauw CVA (REIT) | 2.111.102 | 0,22 | Vereinigte Arabische Emirate | | | |
| | | 25.562.097 | 2,63 | 40.614.366 | Salik Co PJSC | 32.730.781 | 3,37 |
| Brasilien | | | | | | 32.730.781 | 3,37 |
| 3.237.925 | Neoenergia SA | 10.329.154 | 1,06 | Großbritannien | | | |
| | | 10.329.154 | 1,06 | 36.805.398 | Assura Plc (REIT)^ | 21.778.342 | 2,24 |
| Kaimaninseln | | | | 11.207.301 | Life Science Plc (REIT) | 10.432.882 | 1,08 |
| 4.481.000 | CK Asset Holdings Ltd | 24.138.296 | 2,49 | 2.094.338 | National Grid Plc | 28.699.861 | 2,96 |
| 910.409 | IHS Holding Ltd | 7.328.792 | 0,75 | 697.256 | Severn Trent Plc^ | 24.184.983 | 2,49 |
| | | 31.467.088 | 3,24 | 153.659 | SSE Plc | 3.580.786 | 0,37 |
| Dänemark | | | | 445.689 | UNITE Group Plc (REIT) | 4.948.912 | 0,51 |
| 11.697 | Orsted A/S | 1.031.982 | 0,11 | | | 93.625.766 | 9,65 |
| | | 1.031.982 | 0,11 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| Frankreich | | | | 263.488 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)^ | 29.858.460 | 3,08 |
| 101.114 | Aeroports de Paris | 15.492.899 | 1,60 | 107.769 | American Tower Corp (REIT) | 19.450.149 | 2,00 |
| 312.376 | Covivio SA (REIT) | 15.269.434 | 1,57 | 143.344 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | 24.992.027 | 2,57 |
| | | 30.762.333 | 3,17 | 484.774 | Boston Properties Inc (REIT)^ | 23.719.992 | 2,44 |
| Deutschland | | | | 503.936 | Clearway Energy Inc 'C'^ | 14.347.058 | 1,48 |
| 1.727.634 | Vonovia SE | 31.258.117 | 3,22 | 174.429 | Crown Castle Inc (REIT) | 19.501.162 | 2,01 |
| | | 31.258.117 | 3,22 | 223.796 | Digital Realty Trust Inc (REIT)^ | 22.527.305 | 2,32 |
| Guernsey | | | | 14.014 | Equinix Inc (REIT) | 10.360.410 | 1,07 |
| 15.971.968 | Sirius Real Estate Ltd | 15.945.869 | 1,64 | 142.913 | Eversource Energy | 9.765.245 | 1,01 |
| | | 15.945.869 | 1,64 | 13.132 | NextEra Energy Inc | 947.999 | 0,10 |
| Hongkong | | | | 901.605 | Physicians Realty Trust (REIT)^ | 12.297.892 | 1,27 |
| 3.768.040 | Link (REIT) | 21.884.978 | 2,26 | 248.330 | Prologis Inc (REIT) | 30.899.702 | 3,18 |
| | | 21.884.978 | 2,26 | 411.981 | Public Service Enterprise Group Inc | 24.455.192 | 2,52 |
| Italien | | | | 340.497 | Sun Communities Inc (REIT) | 43.195.450 | 4,45 |
| 6.183.934 | Enel SpA | 38.851.430 | 4,00 | | | 286.318.043 | 29,50 |
| 3.527.265 | Terna - Rete Elettrica Nazionale | 29.572.489 | 3,05 | Gesamt Stammaktien | | | |
| | | 68.423.919 | 7,05 | | | 854.026.561 | 87,99 |
| Neuseeland | | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| 917.661 | Auckland International Airport Ltd | 4.884.103 | 0,50 | | | 854.026.561 | 87,99 |
| 94.166 | Chorus Ltd | 462.218 | 0,05 | Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| 1.563.047 | Meridian Energy Ltd | 4.977.379 | 0,51 | STAMMAKTIE | | | |
| | | 10.323.700 | 1,06 | Spanien | | | |
| Philippinen | | | | 5.317 | Edp Renovaveis Sa | 105.852 | 0,01 |
| 9.519.400 | AREIT Inc (REIT) | 5.593.665 | 0,58 | | | 105.852 | 0,01 |
| | | 5.593.665 | 0,58 | Gesamt Stammaktien | | | |
| | | | | | | 105.852 | 0,01 |
| | | | | Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| | | | | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| | | | | 854.132.413 | | | |
| | | | | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| | | | | 116.439.679 | | | |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | | |
| | | | | 970.572.092 | | | |
| | | | | 100,00 | | | |
| | | | | ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Netto(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|---------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | |
| Australien | | | |
| 1.555.269 | National Storage (REIT) | Goldman Sachs | (30.230) |
| | | | (30.230) |
| Portugal | | | |
| 2.179.865 | EDP - Energias de Portugal SA | Goldman Sachs | (747.143) |
| | | | (747.143) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 13.143.620) | | | (777.373) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|--------------|--|-----------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (193.100) | Call | Physicians Realty Trust | Barclays Bank | USD 14,75 | 17/07/2023 | 62.833 | (7.803) |
| (250.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Barclays Bank | GBP 0,83 | 19/07/2023 | (1.327) | (5.732) |
| (160.700) | Call | Physicians Realty Trust | Citibank | USD 14,61 | 15/06/2023 | 55.207 | (829) |
| (23.000) | Call | VGP | Citibank | EUR 94,54 | 20/06/2023 | 16.194 | (42.900) |
| (23.000) | Call | VGP | Citibank | EUR 92,72 | 14/06/2023 | 16.362 | (50.840) |
| (748) | Call | Alexandria Real Estate Equit | Exchange Traded | USD 120,00 | 16/06/2023 | 94.496 | (82.280) |
| (748) | Call | Alexandria Real Estate Equit | Exchange Traded | USD 125,00 | 21/07/2023 | 100.794 | (78.540) |
| (462) | Call | American Tower Corp | Exchange Traded | USD 200,00 | 21/07/2023 | 169.557 | (71.610) |
| (328) | Call | Avalonbay Communities Inc | Exchange Traded | USD 175,00 | 21/07/2023 | 51.100 | (173.840) |
| (317) | Call | Avalonbay Communities Inc | Exchange Traded | USD 180,00 | 16/06/2023 | 49.046 | (45.014) |
| (802) | Call | Boston Properties Inc | Exchange Traded | USD 55,00 | 16/06/2023 | 132.330 | (28.070) |
| (1.379) | Call | Boston Properties Inc | Exchange Traded | USD 50,00 | 21/07/2023 | (20.685) | (358.540) |
| (450) | Call | Clearway Energy Inc | Exchange Traded | USD 30,00 | 16/06/2023 | 21.375 | (14.625) |
| (425) | Call | Crown Castle Inc | Exchange Traded | USD 125,00 | 16/06/2023 | 127.500 | (8.500) |
| (343) | Call | Crown Castle Inc | Exchange Traded | USD 120,00 | 21/07/2023 | 36.015 | (53.165) |
| (228) | Call | Digital Realty Trust Inc | Exchange Traded | USD 100,00 | 16/06/2023 | 368 | (82.080) |
| (224) | Call | Digital Realty Trust Inc | Exchange Traded | USD 105,00 | 16/06/2023 | 23.520 | (34.720) |
| (491) | Call | Digital Realty Trust Inc | Exchange Traded | USD 97,00 | 23/06/2023 | (164.485) | (289.690) |
| (63) | Call | Equinix Inc | Exchange Traded | USD 750,00 | 21/07/2023 | (66.631) | (177.660) |
| (301) | Call | Eversource Energy | Exchange Traded | USD 75,00 | 21/07/2023 | 56.169 | (11.287) |
| (765) | Call | Public Service Enterprise Group Inc | Exchange Traded | USD 65,00 | 16/06/2023 | 109.395 | (7.650) |
| (869) | Call | Sun Communities Inc | Exchange Traded | USD 140,00 | 16/06/2023 | 292.715 | (60.830) |
| (663) | Call | Sun Communities Inc | Exchange Traded | USD 140,00 | 21/07/2023 | 4.641 | (76.245) |
| (25.000) | Call | ADP | Goldman Sachs | EUR 145,04 | 31/05/2023 | 72.592 | — |
| (25.000) | Call | ADP | Goldman Sachs | EUR 146,47 | 13/06/2023 | 34.451 | (17.244) |
| (25.000) | Call | ADP | Goldman Sachs | EUR 145,75 | 08/06/2023 | 41.041 | (10.657) |
| (500.000) | Call | Assura Plc | Goldman Sachs | GBP 0,52 | 13/06/2023 | 5.432 | (108) |
| (600.000) | Call | Assura Plc | Goldman Sachs | GBP 0,52 | 23/06/2023 | 4.131 | (408) |
| (102.600) | Call | Cellnex Telecom Sa | Goldman Sachs | EUR 39,33 | 08/06/2023 | 124.201 | (20.659) |
| (22.200) | Call | Covivio | Goldman Sachs | EUR 57,10 | 08/06/2023 | 17.324 | — |
| (523.900) | Call | EDP - Energias de Portugal SA | Goldman Sachs | EUR 5,16 | 06/06/2023 | 24.379 | (1) |
| (137.500) | Call | EDP - Energias de Portugal SA | Goldman Sachs | EUR 5,24 | 13/06/2023 | 9.193 | (1) |
| (821.400) | Call | EDP - Energias de Portugal SA | Goldman Sachs | EUR 5,04 | 20/06/2023 | 87.027 | (1.180) |
| (1.621.000) | Call | Enel Spa | Goldman Sachs | EUR 5,89 | 31/05/2023 | 151.914 | — |
| (1.161.800) | Call | Enel Spa | Goldman Sachs | EUR 6,26 | 11/07/2023 | 90.735 | (35.490) |
| (210.900) | Call | National Grid Plc | Goldman Sachs | GBP 11,40 | 13/06/2023 | 34.135 | (1.653) |
| (608.000) | Call | National Storage REIT | Goldman Sachs | AUD 2,63 | 31/05/2023 | 31.737 | — |
| (566.000) | Call | National Storage REIT | Goldman Sachs | AUD 2,59 | 08/06/2023 | 17.927 | (3.355) |
| (312.909) | Call | Nextdc Ltd | Goldman Sachs | AUD 12,15 | 06/06/2023 | (39.499) | (114.731) |
| (301.500) | Call | Nextdc Ltd | Goldman Sachs | AUD 12,15 | 19/07/2023 | (114.891) | (155.247) |
| (111.100) | Call | Severn Trent Plc | Goldman Sachs | GBP 29,65 | 13/06/2023 | 52.868 | (1.008) |
| (250.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | GBP 0,78 | 13/06/2023 | (3.015) | (11.512) |
| (250.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | GBP 0,81 | 14/06/2023 | 3.016 | (5.542) |
| (250.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | GBP 0,81 | 12/07/2023 | (1.649) | (7.254) |
| (250.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | GBP 0,81 | 06/07/2023 | (3.242) | (9.158) |
| (250.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | GBP 0,81 | 28/06/2023 | (2.835) | (7.879) |
| (1.125.200) | Call | Terna Rete Elettrica Nazionale | Goldman Sachs | EUR 7,89 | 01/06/2023 | 144.013 | (22.262) |
| (88.600) | Call | Unite Group Plc | Goldman Sachs | GBP 9,59 | 13/06/2023 | 20.819 | (2.510) |
| (10.000) | Call | VGP | Goldman Sachs | EUR 94,76 | 20/06/2023 | 4.821 | (17.744) |
| (411.700) | Call | Vonovia SE | Goldman Sachs | EUR 17,35 | 31/05/2023 | 361.463 | — |
| (260.000) | Call | Vonovia SE | Goldman Sachs | EUR 20,19 | 13/06/2023 | 192.712 | (2.455) |
| (402.443) | Call | Nextdc Ltd | JP Morgan | AUD 10,82 | 31/05/2023 | (414.187) | (492.126) |
| (5.900) | Call | Nextera Energy Inc | JP Morgan | USD 78,35 | 06/07/2023 | 6.508 | (2.109) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|---|--------------|-------------------------------------|----------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (113.100) | Call | Severn Trent Plc | JP Morgan | GBP 29,39 | 01/06/2023 | 46.502 | — |
| (1.000.000) | Call | Assura Plc | Morgan Stanley | GBP 0,50 | 01/06/2023 | 10.839 | (1) |
| (500.000) | Call | Assura Plc | Morgan Stanley | GBP 0,55 | 11/07/2023 | 3.736 | (331) |
| (500.000) | Call | Assura Plc | Morgan Stanley | GBP 0,52 | 19/07/2023 | 2.240 | (2.279) |
| (24.900) | Call | Covivio | Morgan Stanley | EUR 54,48 | 06/06/2023 | 24.697 | — |
| (22.000) | Call | Covivio | Morgan Stanley | EUR 49,67 | 21/06/2023 | 26.720 | (5.332) |
| (100.400) | Call | EDP Renovaveis SA | Morgan Stanley | EUR 21,19 | 11/07/2023 | 42.129 | (4.375) |
| (281) | Call | Eversource Energy | Morgan Stanley | USD 80,01 | 16/06/2023 | 60.154 | (542) |
| (1.096.600) | Call | GPT Group | Morgan Stanley | AUD 4,51 | 14/06/2023 | 47.914 | (1.199) |
| (913.500) | Call | GPT Group | Morgan Stanley | AUD 4,38 | 12/07/2023 | 52.342 | (16.453) |
| (828.400) | Call | Link REIT | Morgan Stanley | HKD 51,00 | 08/06/2023 | 100.236 | (19) |
| (243.000) | Call | Neoenergia SA | Morgan Stanley | USD 15,80 | 29/06/2023 | (16.213) | (37.063) |
| (243.000) | Call | Neoenergia SA | Morgan Stanley | USD 15,80 | 07/06/2023 | (10.887) | (24.228) |
| (243.000) | Call | Neoenergia SA | Morgan Stanley | USD 15,80 | 21/06/2023 | (14.786) | (32.719) |
| (243.000) | Call | Neoenergia SA | Morgan Stanley | USD 15,80 | 14/06/2023 | (13.369) | (28.751) |
| (243.000) | Call | Neoenergia SA | Morgan Stanley | USD 15,80 | 12/07/2023 | (14.605) | (40.606) |
| (243.000) | Call | Neoenergia SA | Morgan Stanley | USD 15,80 | 06/07/2023 | (13.945) | (37.784) |
| (502) | Call | Prologis Inc | Morgan Stanley | USD 122,94 | 16/06/2023 | 69.886 | (159.528) |
| (615) | Call | Prologis Inc | Morgan Stanley | USD 124,82 | 21/07/2023 | 67 | (282.218) |
| (629) | Call | Public Service Enterprise Group Inc | Morgan Stanley | USD 64,85 | 21/07/2023 | 91.186 | (11.341) |
| (404) | Call | Public Service Enterprise Group Inc | Morgan Stanley | USD 61,75 | 10/08/2023 | 47.313 | (40.759) |
| (577.600) | Call | Region RE Ltd | Morgan Stanley | AUD 2,50 | 12/07/2023 | 4.209 | (11.782) |
| (100.000) | Call | Severn Trent Plc | Morgan Stanley | GBP 30,47 | 23/06/2023 | 29.060 | (1.152) |
| (20.000) | Call | Aedifica | UBS | EUR 76,50 | 06/06/2023 | 33.105 | — |
| (269.800) | Call | APA Group | UBS | AUD 10,89 | 06/06/2023 | 22.038 | — |
| (380.000) | Call | APA Group | UBS | AUD 10,11 | 12/07/2023 | 8.929 | (14.630) |
| (191.000) | Call | Auckland International Airport Ltd | UBS | NZD 9,01 | 06/06/2023 | 8.353 | (1.708) |
| (205.100) | Call | Auckland International Airport Ltd | UBS | NZD 8,94 | 14/06/2023 | 6.322 | (8.675) |
| (42.300) | Call | Chorus Ltd | UBS | NZD 8,78 | 06/06/2023 | 3.126 | — |
| (14.500) | Call | Covivio | UBS | EUR 50,11 | 11/07/2023 | 16.134 | (7.260) |
| (965.200) | Call | Dexus | UBS | AUD 7,91 | 06/06/2023 | (128.556) | (197.556) |
| (680.000) | Call | Dexus | UBS | AUD 7,84 | 13/06/2023 | (110.990) | (181.612) |
| (710.900) | Call | EDP - Energias de Portugal SA | UBS | EUR 4,92 | 28/06/2023 | 62.556 | (7.565) |
| (785.400) | Call | Goodman Group | UBS | AUD 20,61 | 23/06/2023 | 121.416 | (69.127) |
| (206.000) | Call | Meridian Energy Ltd | UBS | NZD 5,34 | 06/06/2023 | 6.329 | (8.050) |
| (439.900) | Call | Meridian Energy Ltd | UBS | NZD 5,30 | 14/06/2023 | 463 | (34.593) |
| (580.300) | Call | National Grid Plc | UBS | GBP 11,49 | 01/06/2023 | 67.747 | (1) |
| (870.850) | Call | National Storage REIT | UBS | AUD 2,56 | 21/06/2023 | 2.495 | (20.903) |
| (967.400) | Call | National Storage REIT | UBS | AUD 2,65 | 19/07/2023 | (414) | (16.315) |
| (249.000) | Call | Nextdc Ltd | UBS | AUD 12,28 | 11/07/2023 | (66.435) | (104.918) |
| (225.607) | Call | Nextdc Ltd | UBS | AUD 12,30 | 18/07/2023 | (59.489) | (99.835) |
| (660.000) | Call | Region RE Ltd | UBS | AUD 2,46 | 07/06/2023 | (3.697) | (26.243) |
| (350.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | UBS | GBP 0,82 | 06/06/2023 | 8.906 | (3.058) |
| (250.000) | Call | Sirius Real Estate Ltd | UBS | GBP 0,85 | 23/06/2023 | 1.756 | (2.877) |
| (438.600) | Call | Terna Rete Elettrica Nazionale | UBS | EUR 7,95 | 18/07/2023 | (9.126) | (52.054) |
| (98.500) | Call | Transurban Group | UBS | AUD 15,25 | 23/06/2023 | 2.919 | (4.976) |
| (864.000) | Call | Transurban Group | UBS | AUD 14,86 | 19/07/2023 | (48.072) | (105.783) |
| (43.800) | Call | Cellnex Telecom SA | Warburg Dillon | EUR 37,83 | 21/06/2023 | (3.151) | (53.680) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 98.739.270) | | | | | | 2.637.699 | (4.464.624) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| AUD | 103.431 | USD | 70.306 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (3.260) |
| USD | 3.547 | AUD | 5.378 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 61 |
| | | | | | | (3.199) |
| Auf CAD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CAD | 4.863 | USD | 3.648 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (76) |
| USD | 184 | CAD | 248 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1 |
| | | | | | | (75) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 3.713.874 | USD | 4.192.991 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (117.638) |
| USD | 406.684 | CHF | 364.157 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 7.080 |
| | | | | | | (110.558) |
| Auf CNH lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CNH | 59.606.610 | USD | 8.608.116 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (237.445) |
| USD | 461.211 | CNH | 3.237.594 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 6.549 |
| | | | | | | (230.896) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 38.463.803 | USD | 42.522.638 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.422.000) |
| USD | 2.559.528 | EUR | 2.367.814 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 29.391 |
| | | | | | | (1.392.609) |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 45.458 | USD | 57.585 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.296) |
| USD | 2.880 | GBP | 2.320 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 6 |
| | | | | | | (1.290) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf HKD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| HKD | 36.633.341 | USD | 4.674.018 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 3.871 |
| USD | 401.197 | HKD | 3.142.029 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (24) |
| | | | | | | 3.847 |
| Auf SGD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SGD | 53.722.447 | USD | 40.594.295 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (898.766) |
| USD | 3.113.724 | SGD | 4.189.156 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 18.356 |
| | | | | | | (880.410) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 104.934.516) | | | | | | (2.615.190) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 50,57 |
| Versorger | 23,72 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 5,70 |
| Industrie | 5,39 |
| Kommunikation | 1,65 |
| Energie | 0,97 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 88,00 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 12,00 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand Wertpapierbezeichnung | | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand Wertpapierbezeichnung | | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------|--------------|--|---|------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| Deutschland | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| EUR 2.604 | iShares SLI UCITS ETF DE ⁻ | 331.750 | 0,34 | EUR 7.904 | iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc) ⁻ | 1.199.274 | 1,25 |
| | | 331.750 | 0,34 | EUR 645.657 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻ | 3.011.667 | 3,14 |
| Irland | | | | EUR 518.486 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 3.402.824 | 3,54 |
| USD 109.029 | iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻ | 652.489 | 0,68 | EUR 223.337 | iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 1.227.014 | 1,28 |
| USD 9.084 | iShares Agribusiness UCITS ETF ⁻ | 374.204 | 0,39 | EUR 253.093 | iShares MSCI Pacific EX-Japan ESG Enhanced UCITS ETF ⁻ | 1.110.952 | 1,16 |
| USD 316.143 | iShares China CNY Bond UCITS ETF ⁻ | 1.519.944 | 1,58 | EUR 2.467.751 | iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 17.380.370 | 18,11 |
| GBP 3.693 | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻ | 591.445 | 0,62 | USD 81.384 | iShares Physical Gold ETC ⁻ | 2.922.469 | 3,04 |
| GBP 15.089 | iShares Core GBP Corporate Bond UCITS ETF ⁻ | 2.064.057 | 2,15 | EUR 1.145.123 | iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF (Acc) ⁻ | 4.872.040 | 5,08 |
| EUR 3.618 | iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF ⁻ | 533.583 | 0,56 | EUR 284.704 | iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 1.361.967 | 1,42 |
| EUR 132.741 | iShares Core UK Gilts UCITS ETF ⁻ | 1.543.778 | 1,61 | EUR 13.155 | iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻ | 2.849.899 | 2,97 |
| USD 104.779 | iShares Digital Security UCITS ETF 'A' ⁻ | 649.919 | 0,68 | EUR 317.985 | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 1.503.719 | 1,57 |
| EUR 86.628 | iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 8.394.253 | 8,75 | EUR 53.668 | iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF 'D' ⁻ | 6.395.079 | 6,66 |
| EUR 419.751 | iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 2.010.523 | 2,09 | EUR 40.616 | iShares USD Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF ⁻ | 4.872.295 | 5,08 |
| EUR 3.082.261 | iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻ | 12.645.901 | 13,17 | EUR 22.044 | iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻ | 3.662.831 | 3,82 |
| EUR 10.711 | iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF ⁻ | 2.402.906 | 2,50 | | | 96.523.233 | 100,57 |
| USD 10.427 | iShares Global Water UCITS ETF ⁻ | 560.143 | 0,58 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 96.854.983 | 100,91 |
| USD 47.030 | iShares Healthcare Innovation UCITS ETF ⁻ | 325.169 | 0,34 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 96.854.983 | 100,91 |
| EUR 91.407 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻ | 3.790.648 | 3,95 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 96.854.983 | 100,91 |
| EUR 586.477 | iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻ | 2.691.871 | 2,80 | Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | (875.682) | (0,91) |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | |
| | | | | 95.979.301 100,00 | | | |
| | | | | ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISETERMINGSCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 2.507.925 | GBP | 2.205.206 | Deutsche Bank | 5/6/2023 | (48.414) |
| EUR | 1.671.651 | GBP | 1.470.000 | Lloyds Bank Corporate Markets PLC | 5/6/2023 | (32.416) |
| EUR | 714.488 | USD | 770.419 | BNP Paribas | 5/6/2023 | (6.926) |
| EUR | 41.982.233 | USD | 46.433.525 | State Street Bank & Trust Company | 5/6/2023 | (1.497.726) |
| USD | 598.211 | EUR | 551.643 | Barclays Bank | 5/6/2023 | 8.517 |
| USD | 584.058 | EUR | 544.373 | Societe Generale | 5/6/2023 | 2.534 |
| | | | | | | (1.574.431) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISETERMINGSCHÄFTE | | | | | | |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 7.684 | GBP | 6.682 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (60) |
| GBP | 595.268 | EUR | 681.634 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 8.164 |
| | | | | | | 8.104 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 352.589 | USD | 386.263 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (8.891) |
| USD | 19.942.711 | EUR | 18.022.137 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 641.130 |
| | | | | | | 632.239 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 69.291.136) | | | | | | (934.088) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023 Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|-----------------|
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 100,91 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 100,91 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (0,91) |
| | 100,00 |

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | | |
|--|--|---|------------------------|--------------------|--|--|---|------------------------|--------------------|-------------|--------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | Irland Fortsetzung | | | | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | | | | | | | | |
| Deutschland | | | | | | | | | | | |
| EUR 153.328 | | iShares eb.rexx Government Germany 0-1yr UCITS ETF DE ⁻ | 11.185.278 | 7,57 | EUR 1.025.528 | | iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻ | 4.707.071 | 3,18 | | |
| EUR 2.171 | | iShares SLI UCITS ETF DE ⁻ | 276.585 | 0,19 | EUR 3.843 | | iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc) ⁻ | 583.098 | 0,39 | | |
| | | | 11.461.863 | 7,76 | EUR 320.393 | | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻ | 1.494.473 | 1,01 | | |
| Irland | | | | | EUR 252.816 | | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 1.659.231 | 1,12 | | |
| USD 57.039 | | iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻ | 341.353 | 0,23 | EUR 102.502 | | iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 563.146 | 0,38 | | |
| USD 4.505 | | iShares Agribusiness UCITS ETF ⁻ | 185.578 | 0,12 | EUR 127.190 | | iShares MSCI Pacific EX-Japan ESG Enhanced UCITS ETF ⁻ | 558.301 | 0,38 | | |
| USD 933.662 | | iShares China CNY Bond UCITS ETF ⁻ | 4.488.836 | 3,04 | EUR 1.195.151 | | iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 8.417.449 | 5,70 | | |
| GBP 2.151 | | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻ | 344.489 | 0,23 | USD 62.091 | | iShares Physical Gold ETC ⁻ | 2.229.665 | 1,51 | | |
| GBP 21.474 | | iShares Core GBP Corporate Bond UCITS ETF ⁻ | 2.937.474 | 1,99 | EUR 1.742.534 | | iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF (Acc) ⁻ | 7.413.785 | 5,02 | | |
| EUR 1.830 | | iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF ⁻ | 269.888 | 0,18 | EUR 707.486 | | iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 3.384.472 | 2,29 | | |
| EUR 379.411 | | iShares Core UK Gilts UCITS ETF ⁻ | 4.412.550 | 2,99 | EUR 27.426 | | iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻ | 5.941.569 | 4,02 | | |
| USD 51.653 | | iShares Digital Security UCITS ETF 'A' ⁻ | 320.391 | 0,22 | EUR 614.709 | | iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 2.906.897 | 1,97 | | |
| EUR 248.896 | | iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 1.192.162 | 0,81 | EUR 155.559 | | iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF 'D' ⁻ | 18.536.411 | 12,54 | | |
| EUR 30.368 | | iShares Euro Corporate Bond Interest Rate Hedged ESG UCITS ETF 'H' ⁻ | 2.831.816 | 1,92 | EUR 49.268 | | iShares USD Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF ⁻ | 5.910.189 | 4,00 | | |
| EUR 6.884.585 | | iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻ | 28.246.075 | 19,12 | EUR 97.885 | | iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ^{-A} | 16.264.572 | 11,01 | | |
| EUR 22.410 | | iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF ⁻ | 5.027.459 | 3,40 | | | | 136.347.537 | 92,27 | | |
| USD 5.124 | | iShares Global Water UCITS ETF ⁻ | 275.264 | 0,19 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | | 147.809.400 | 100,03 | | |
| USD 24.604 | | iShares Healthcare Innovation UCITS ETF ⁻ | 170.114 | 0,11 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | 147.809.400 | 100,03 |
| EUR 114.149 | | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻ | 4.733.759 | 3,20 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | | | 147.809.400 | 100,03 |
| | | | | | Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | | | | (45.246) | (0,03) |
| | | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | | | 147.764.154 | 100,00 |

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

^A Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 3.138.878 | GBP | 2.760.000 | Bank of America Merrill Lynch | 5/6/2023 | (60.594) |
| EUR | 1.687.834 | GBP | 1.484.106 | Barclays Bank | 5/6/2023 | (32.586) |
| EUR | 2.853.472 | GBP | 2.480.023 | Citibank | 5/6/2023 | (21.443) |
| EUR | 995.202 | USD | 1.094.642 | Morgan Stanley | 5/6/2023 | (29.811) |
| EUR | 88.805.745 | USD | 98.221.640 | State Street Bank & Trust Company | 5/6/2023 | (3.168.166) |
| USD | 13.329.164 | EUR | 12.361.494 | BNP Paribas | 5/6/2023 | 119.822 |
| USD | 1.947.715 | EUR | 1.788.337 | HSBC | 5/6/2023 | 35.486 |
| USD | 913.922 | EUR | 833.092 | JP Morgan | 5/6/2023 | 22.697 |
| USD | 841.263 | EUR | 784.102 | Societe Generale | 5/6/2023 | 3.650 |
| | | | | | | (3.130.945) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 1.562.012 | EUR | 1.594.021 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 10.058 |
| EUR | 20.286 | CHF | 19.699 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 57 |
| | | | | | | 10.115 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 299.926 | GBP | 260.709 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (2.184) |
| GBP | 13.864.354 | EUR | 15.878.543 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 187.499 |
| | | | | | | 185.315 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf PLN lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 65 | PLN | 294 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| PLN | 23.531 | EUR | 5.133 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 47 |
| | | | | | | 47 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 4.588.443 | USD | 4.992.723 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (83.970) |
| USD | 82.126.314 | EUR | 74.238.624 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 2.618.806 |
| | | | | | | 2.534.836 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 216.269.956) | | | | | | (400.632) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 100,03 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 100,03 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (0,03) |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | |
|--|--|---|------------------------|--------------------|---|--|---|------------------------|--------------------|--------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | Irland Fortsetzung | | | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | | | | | | | |
| Deutschland | | | | | | | | | | |
| EUR 22.039 | | iShares SLI UCITS ETF DE ⁻ | 2.807.768 | 0,59 | EUR 7.384.856 | | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻ | 34.446.661 | 7,33 | |
| EUR 1.251.178 | | iShares STOXX Europe 600 Banks UCITS ETF DE ⁻ | 18.562.477 | 3,95 | EUR 2.615.301 | | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 17.164.221 | 3,65 | |
| | | | 21.370.245 | 4,54 | EUR 1.113.135 | | iShares MSCI Europe Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 7.347.804 | 1,56 | |
| Irland | | | | | EUR 2.252.753 | | iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ^{-^} | 12.376.625 | 2,63 | |
| USD 1.329.864 | | iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻ | 7.958.635 | 1,69 | EUR 2.497.512 | | iShares MSCI Pacific EX-Japan ESG Enhanced UCITS ETF ⁻ | 10.962.829 | 2,33 | |
| USD 113.203 | | iShares Agribusiness UCITS ETF ⁻ | 4.663.254 | 0,99 | EUR 12.927.046 | | iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 91.045.185 | 19,37 | |
| GBP 7.785 | | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻ | 1.246.792 | 0,27 | EUR 8.228.728 | | iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF ⁻ | 63.196.631 | 13,44 | |
| GBP 34.728 | | iShares Core GBP Corporate Bond UCITS ETF ⁻ | 4.750.517 | 1,01 | EUR 5.330.772 | | iShares MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 31.925.994 | 6,79 | |
| EUR 46.433 | | iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF ⁻ | 6.847.939 | 1,46 | EUR 2.460.131 | | iShares MSCI World Momentum Factor ESG UCITS ETF ⁻ | 9.271.004 | 1,97 | |
| EUR 409.062 | | iShares Core UK Gilts UCITS ETF ⁻ | 4.757.391 | 1,01 | EUR 440.496 | | iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF ⁻ | 1.962.410 | 0,42 | |
| USD 1.280.873 | | iShares Digital Security UCITS ETF 'A' ⁻ | 7.944.953 | 1,69 | USD 401.658 | | iShares Physical Gold ETC ⁻ | 14.423.390 | 3,07 | |
| EUR 755.101 | | iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF ⁻ | 4.287.464 | 0,91 | EUR 2.786.748 | | iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF (Acc) ⁻ | 11.856.498 | 2,52 | |
| USD 212.881 | | iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF ^{-^} | 10.271.722 | 2,19 | EUR 2.047.244 | | iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻ | 7.324.630 | 1,56 | |
| USD 123.915 | | iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF ⁻ | 4.404.191 | 0,94 | EUR 26.951 | | iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻ | 4.478.178 | 0,95 | |
| EUR 5.776.988 | | iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻ | 23.701.826 | 5,04 | | | | 451.549.393 | 96,05 | |
| USD 129.094 | | iShares Global Water UCITS ETF ⁻ | 6.934.988 | 1,48 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | | | 472.919.638 | 100,59 |
| USD 570.330 | | iShares Healthcare Innovation UCITS ETF ⁻ | 3.943.303 | 0,84 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | 472.919.638 | 100,59 |
| EUR 427.937 | | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻ | 17.746.547 | 3,77 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | | 472.919.638 | 100,59 |
| EUR 2.429.663 | | iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻ | 11.151.910 | 2,37 | Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | | | (2.795.949) | (0,59) |
| EUR 86.706 | | iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc) ⁻ | 13.155.901 | 2,80 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | | 470.123.689 | 100,00 |

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

[^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-----------|---------|-----------|-------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 892.761 | GBP | 785.000 | Bank of America Merrill Lynch | 5/6/2023 | (17.234) |
| EUR | 9.512.917 | GBP | 8.267.910 | Citibank | 5/6/2023 | (71.486) |
| EUR | 482.135 | GBP | 423.980 | Toronto Dominion Bank | 5/6/2023 | (9.355) |
| EUR | 2.801.662 | USD | 3.081.602 | Morgan Stanley | 5/6/2023 | (83.924) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 193.321.663 | USD | 213.819.173 | State Street Bank & Trust Company | 5/6/2023 | (6.896.797) |
| USD | 30.935.221 | EUR | 28.689.387 | BNP Paribas | 5/6/2023 | 278.091 |
| USD | 3.723.155 | EUR | 3.475.132 | Morgan Stanley | 5/6/2023 | 11.198 |
| | | | | | | (6.789.507) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 1.597.300 | EUR | 1.631.048 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 9.269 |
| EUR | 87.366 | CHF | 85.089 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (13) |
| | | | | | | 9.256 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 2.139.260 | GBP | 1.860.749 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (16.979) |
| GBP | 62.902.013 | EUR | 72.042.912 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 848.071 |
| | | | | | | 831.092 |
| Auf PLN lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 86 | PLN | 390 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| PLN | 24.563 | EUR | 5.359 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 48 |
| | | | | | | 48 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 3.460.757 | USD | 3.761.097 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (59.044) |
| USD | 92.574.595 | EUR | 83.699.500 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 2.935.889 |
| | | | | | | 2.876.845 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 413.479.346) | | | | | | (3.072.266) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 100,59 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 100,59 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (0,59) |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | | | | | |
| Deutschland | | | | | | | |
| EUR 20.679 | iShares SLI UCITS ETF DE ⁻ | 2.634.505 | 0,40 | EUR 5.945.783 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ^{-^} | 27.734.105 | 4,28 |
| | | 2.634.505 | 0,40 | EUR 4.041.369 | iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ^{-^} | 26.523.505 | 4,09 |
| | | | | EUR 711.537 | iShares MSCI Europe Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 4.696.856 | 0,72 |
| Irland | | | | EUR 2.053.602 | iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 11.282.489 | 1,74 |
| USD 1.038.655 | iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻ | 6.215.881 | 0,96 | EUR 2.583.385 | iShares MSCI Pacific EX-Japan ESG Enhanced UCITS ETF ⁻ | 11.339.768 | 1,75 |
| USD 88.724 | iShares Agribusiness UCITS ETF ⁻ | 3.654.873 | 0,56 | EUR 14.602.763 | iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻ | 102.847.260 | 15,86 |
| USD 1.881.811 | iShares China CNY Bond UCITS ETF ⁻ | 9.047.323 | 1,39 | EUR 2.719.821 | iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF ⁻ | 20.888.225 | 3,22 |
| GBP 24.928 | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻ | 3.992.297 | 0,62 | EUR 4.307.464 | iShares MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 25.797.402 | 3,98 |
| GBP 71.096 | iShares Core GBP Corporate Bond UCITS ETF ⁻ | 9.725.373 | 1,50 | EUR 1.537.027 | iShares MSCI World Momentum Factor ESG UCITS ETF ⁻ | 5.792.286 | 0,89 |
| EUR 25.493 | iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF ⁻ | 3.759.708 | 0,58 | EUR 276.178 | iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF ⁻ | 1.230.373 | 0,19 |
| EUR 612.803 | iShares Core UK Gilts UCITS ETF ⁻ | 7.126.899 | 1,10 | USD 548.191 | iShares Physical Gold ETC ⁻ | 19.685.336 | 3,04 |
| USD 988.091 | iShares Digital Security UCITS ETF 'A' ⁻ | 6.128.895 | 0,94 | EUR 6.164.753 | iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF (Acc) ⁻ | 26.228.558 | 4,04 |
| EUR 469.528 | iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF ⁻ | 2.665.980 | 0,41 | EUR 1.369.804 | iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 6.552.868 | 1,01 |
| USD 133.501 | iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF ⁻ | 6.441.557 | 0,99 | EUR 53.009 | iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻ | 11.483.870 | 1,77 |
| USD 77.039 | iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF ⁻ | 2.738.123 | 0,42 | EUR 355.443 | iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF 'D' ⁻ | 42.354.588 | 6,53 |
| EUR 226.665 | iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻ | 21.963.838 | 3,39 | EUR 271.178 | iShares USD Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF ⁻ | 32.530.513 | 5,02 |
| EUR 2.355.016 | iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 11.280.056 | 1,74 | EUR 162.571 | iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻ | 27.012.797 | 4,16 |
| EUR 17.638.627 | iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻ | 72.367.759 | 11,16 | | | 648.780.365 | 100,03 |
| EUR 75.424 | iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF ⁻ | 16.920.620 | 2,61 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 651.414.870 | 100,43 |
| USD 98.809 | iShares Global Water UCITS ETF ⁻ | 5.308.064 | 0,82 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| USD 452.557 | iShares Healthcare Innovation UCITS ETF ⁻ | 3.129.012 | 0,48 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| EUR 577.913 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻ | 23.966.052 | 3,70 | Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | | |
| EUR 3.806.251 | iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻ | 17.470.311 | 2,69 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | |
| EUR 71.818 | iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc) ⁻ | 10.896.945 | 1,68 | (2.806.249) (0,43) | | | |
| | | | | 648.608.621 100,00 | | | |
| | | | | ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. [^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. | | | |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 11.583.143 | GBP | 10.185.000 | Bank of America Merrill Lynch | 5/6/2023 | (223.607) |
| EUR | 6.237.682 | GBP | 5.485.293 | Toronto Dominion Bank | 5/6/2023 | (121.030) |
| EUR | 327.863.345 | USD | 362.626.039 | State Street Bank & Trust Company | 5/6/2023 | (11.696.604) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-----------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 54.612.414 | EUR | 50.647.664 | BNP Paribas | 5/6/2023 | 490.937 |
| USD | 3.479.530 | EUR | 3.247.737 | Morgan Stanley | 5/6/2023 | 10.466 |
| USD | 4.308.662 | EUR | 3.991.812 | Natwest Markets | 5/6/2023 | 42.783 |
| | | | | | | (11.497.055) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 4.168.149 | EUR | 4.255.360 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 25.046 |
| EUR | 84.475 | CHF | 82.135 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 127 |
| | | | | | | 25.173 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 2.262.203 | GBP | 1.967.368 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (17.586) |
| GBP | 101.276.858 | EUR | 115.986.946 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1.372.886 |
| | | | | | | 1.355.300 |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 8.768.406 | USD | 9.557.221 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (175.665) |
| USD | 212.075.006 | EUR | 191.702.240 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 6.766.907 |
| | | | | | | 6.591.242 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 747.574.400) | | | | | | (3.525.340) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 100,43 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 100,43 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (0,43) |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| ANLEIHEN | | | |
| | Kanada | | |
| USD 4.000.000 | Export Development Canada 2,625% 21/2/2024 | 3.924.365 | 3,28 |
| | | <u>3.924.365</u> | <u>3,28</u> |
| | Supranationale Anleihen | | |
| USD 10.000.000 | Council Of Europe Development Bank 2,50% 27/2/2024 | 9.794.500 | 8,18 |
| USD 6.500.000 | European Bank for Reconstruction & Development 0,25% 10/7/2023 | 6.466.005 | 5,40 |
| USD 6.000.000 | Inter-American Development Bank 3,00% 4/10/2023 | 5.947.721 | 4,97 |
| USD 15.000.000 | International Bank for Reconstruction & Development 3,00% 27/9/2023 | 14.877.332 | 12,43 |
| | | <u>37.085.558</u> | <u>30,98</u> |
| | Vereinigte Staaten von Amerika | | |
| USD 6.000.000 | United States Treasury Bill 1/6/2023 (Zero Coupon) | 6.000.000 | 5,01 |
| USD 10.078.000 | United States Treasury Bill 10/8/2023 (Zero Coupon) | 9.999.569 | 8,35 |
| USD 5.000.000 | United States Treasury Bill 24/8/2023 (Zero Coupon) | 4.940.541 | 4,13 |
| USD 11.000.000 | United States Treasury Bill 5/10/2023 (Zero Coupon) | 10.828.910 | 9,05 |
| USD 12.000.000 | United States Treasury Bill 30/11/2023 (Zero Coupon) | 11.717.824 | 9,79 |
| USD 9.000.000 | United States Treasury Bill 28/12/2023 (Zero Coupon) | 8.769.840 | 7,33 |
| USD 11.500.000 | United States Treasury Bill 16/5/2024 (Zero Coupon) | 10.946.674 | 9,15 |
| | | <u>63.203.358</u> | <u>52,81</u> |
| Gesamt Anleihen | | <u>104.213.281</u> | <u>87,07</u> |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | <u>104.213.281</u> | <u>87,07</u> |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | <u>104.213.281</u> | <u>87,07</u> |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 15.482.904 | 12,93 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | <u>119.696.185</u> | <u>100,00</u> |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---|-------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | (1) | Deterra Royalties Ltd ¹¹ | Bank of America Merrill Lynch | — |
| Australien | | | | (10.669) | Endeavour Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.244 |
| (1.672) | ANZ Group Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 661 | (9.050) | Endeavour Group Ltd | Barclays Bank | 762 |
| (1.764) | ANZ Group Holdings Ltd | Barclays Bank | 994 | (4.876) | Endeavour Group Ltd | BNP Paribas | 569 |
| (3.751) | ANZ Group Holdings Ltd | BNP Paribas | 1.482 | (9.043) | Endeavour Group Ltd | Goldman Sachs | 1.055 |
| (1.564) | ANZ Group Holdings Ltd | Citibank | 882 | (12.344) | Endeavour Group Ltd | HSBC | 1.919 |
| (6.054) | ANZ Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | 2.393 | (3.147) | Endeavour Group Ltd | JP Morgan | 489 |
| (1.452) | ANZ Group Holdings Ltd | HSBC | 856 | 662 | Fortescue Metals Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (498) |
| (691) | ANZ Group Holdings Ltd | JP Morgan | 407 | 2.105 | Fortescue Metals Group Ltd | Barclays Bank | (1.827) |
| (8.739) | APA Group (Unit) | BNP Paribas | 1.189 | 7.510 | Fortescue Metals Group Ltd | BNP Paribas | (5.644) |
| (5.688) | APA Group (Unit) | Goldman Sachs | 774 | 1.350 | Fortescue Metals Group Ltd | Goldman Sachs | (1.015) |
| 402 | Aristocrat Leisure Ltd | Barclays Bank | (321) | 1.003 | Fortescue Metals Group Ltd | HSBC | (923) |
| 4.486 | Aristocrat Leisure Ltd | BNP Paribas | (6.859) | 1.031 | IDP Education Ltd | BNP Paribas | (3.881) |
| 7.473 | Aristocrat Leisure Ltd | Goldman Sachs | (11.427) | 296 | IDP Education Ltd | Goldman Sachs | (1.114) |
| (800) | ASX Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 684 | (1.249) | IGO Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 332 |
| (848) | ASX Ltd | Barclays Bank | 478 | (3.831) | IGO Ltd | Barclays Bank | 1.539 |
| (2.176) | ASX Ltd | BNP Paribas | 1.861 | (11.678) | IGO Ltd | BNP Paribas | 3.102 |
| (547) | ASX Ltd | Goldman Sachs | 468 | (3.910) | IGO Ltd | Citibank | 1.571 |
| (223) | ASX Ltd | JP Morgan | 332 | (2.563) | IGO Ltd | HSBC | 1.046 |
| (9.954) | Aurizon Holdings Ltd | Barclays Bank | (252) | (2) | Iluka Resources Ltd ¹¹ | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (10.889) | Aurizon Holdings Ltd | BNP Paribas | (353) | (59.131) | Insurance Australia Group Ltd | Barclays Bank | 383 |
| (33.890) | Aurizon Holdings Ltd | Citibank | (657) | (28.904) | Insurance Australia Group Ltd | BNP Paribas | (5.618) |
| (15.767) | Aurizon Holdings Ltd | Goldman Sachs | (511) | (6.286) | Insurance Australia Group Ltd | JP Morgan | (855) |
| (5.136) | Aurizon Holdings Ltd | JP Morgan | (233) | 2.182 | James Hardie Industries Plc - CDI | Barclays Bank | 156 |
| 3.586 | BlueScope Steel Ltd | Barclays Bank | (1.952) | 3.080 | James Hardie Industries Plc - CDI | BNP Paribas | 7.783 |
| 1.705 | BlueScope Steel Ltd | BNP Paribas | (1.060) | 2.132 | James Hardie Industries Plc - CDI | Goldman Sachs | 5.387 |
| 9.754 | BlueScope Steel Ltd | Goldman Sachs | (6.067) | (6.691) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 1.257 |
| 1.266 | Brambles Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (558) | (2.678) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | Barclays Bank | (35) |
| 1.128 | Brambles Ltd | Barclays Bank | (541) | (4.876) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | BNP Paribas | 916 |
| 24.406 | Brambles Ltd | BNP Paribas | (10.753) | (8.961) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | Goldman Sachs | 1.684 |
| 1.057 | Brambles Ltd | Goldman Sachs | (466) | (1.968) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | HSBC | (140) |
| 1.310 | Brambles Ltd | HSBC | (373) | 3.258 | Lottery Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 63 |
| 1.200 | Brambles Ltd | JP Morgan | (342) | 35.018 | Lottery Corp Ltd | Barclays Bank | 227 |
| 344 | Cochlear Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.163) | 19.626 | Lottery Corp Ltd | BNP Paribas | 381 |
| 1.810 | Cochlear Ltd | Barclays Bank | (1.746) | 15.107 | Lottery Corp Ltd | Citibank | 98 |
| 752 | Cochlear Ltd | BNP Paribas | (2.543) | 10.438 | Lottery Corp Ltd | Goldman Sachs | 203 |
| 279 | Cochlear Ltd | Citibank | (282) | 12.356 | Lottery Corp Ltd | HSBC | 160 |
| 311 | Cochlear Ltd | Goldman Sachs | (1.052) | 170 | Macquarie Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (452) |
| 189 | Cochlear Ltd | HSBC | (60) | 250 | Macquarie Group Ltd | Barclays Bank | (944) |
| 147 | Cochlear Ltd | JP Morgan | (47) | 317 | Macquarie Group Ltd | BNP Paribas | (842) |
| 379 | Coles Group Ltd | Barclays Bank | (39) | 270 | Macquarie Group Ltd | Citibank | (1.020) |
| 6.717 | Coles Group Ltd | BNP Paribas | (1.523) | 477 | Macquarie Group Ltd | Goldman Sachs | (1.267) |
| 9.112 | Coles Group Ltd | Goldman Sachs | (2.066) | 176 | Macquarie Group Ltd | HSBC | (315) |
| 2.339 | Coles Group Ltd | HSBC | (167) | 269 | Macquarie Group Ltd | JP Morgan | (481) |
| (263) | Commonwealth Bank of Australia | Bank of America Merrill Lynch | 293 | (58.982) | Medibank Pvt Ltd | Goldman Sachs | (1.146) |
| (1.068) | Commonwealth Bank of Australia | Barclays Bank | 1.428 | (614) | Mineral Resources Ltd | Barclays Bank | 1.571 |
| (2.025) | Commonwealth Bank of Australia | BNP Paribas | 2.257 | (1.498) | Mineral Resources Ltd | BNP Paribas | 2.873 |
| (1.529) | Commonwealth Bank of Australia | Goldman Sachs | 1.704 | (347) | Mineral Resources Ltd | HSBC | 139 |
| (161) | Commonwealth Bank of Australia | HSBC | 35 | (1.140) | National Australia Bank Ltd | BNP Paribas | 362 |
| (645) | Computershare Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (226) | (993) | National Australia Bank Ltd | HSBC | 184 |
| (4.036) | Computershare Ltd | Barclays Bank | (1.177) | (1.131) | Newcrest Mining Ltd | BNP Paribas | 2.191 |
| (7.993) | Computershare Ltd | BNP Paribas | (2.796) | (135) | Newcrest Mining Ltd | HSBC | 342 |
| (2.845) | Computershare Ltd | Goldman Sachs | (995) | (7.037) | Orica Ltd | BNP Paribas | 5.106 |
| (8.684) | Computershare Ltd | HSBC | (2.082) | (8.514) | Pilbara Minerals Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.765 |
| (254) | CSL Ltd | Barclays Bank | 140 | (5.403) | Pilbara Minerals Ltd | BNP Paribas | 1.120 |
| (548) | CSL Ltd | BNP Paribas | 504 | | | | |
| (588) | CSL Ltd | Goldman Sachs | 541 | | | | |
| (262) | CSL Ltd | HSBC | (869) | | | | |
| (288) | CSL Ltd | JP Morgan | (955) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|---|-------------------------------|---|-------------------------------|-----------------------------|-------------------------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| (11.888) | Pilbara Minerals Ltd | Goldman Sachs | 2.465 | 1.790 | Wesfarmers Ltd | BNP Paribas | (4.824) |
| (8.381) | Qantas Airways Ltd | Barclays Bank | (1.023) | 1.779 | Wesfarmers Ltd | Goldman Sachs | (4.795) |
| (17.790) | Qantas Airways Ltd | Citibank | (2.217) | 366 | Wesfarmers Ltd | HSBC | (908) |
| (1) | Ramsay Health Care Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3 | (7.230) | Westpac Banking Corp | Barclays Bank | 1.780 |
| (1.483) | Ramsay Health Care Ltd | Barclays Bank | 2.354 | (2.243) | Westpac Banking Corp | BNP Paribas | 654 |
| (3.467) | Ramsay Health Care Ltd | BNP Paribas | 9.053 | (1.794) | Westpac Banking Corp | Goldman Sachs | 523 |
| (1.974) | Ramsay Health Care Ltd | Goldman Sachs | 5.154 | (908) | WiseTech Global Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.135) |
| (169) | Ramsay Health Care Ltd | HSBC | 417 | (2.044) | Woodside Energy Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (503) |
| (204) | REA Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (110) | (3.000) | Woodside Energy Group Ltd | Barclays Bank | 641 |
| (186) | REA Group Ltd | Barclays Bank | 118 | (560) | Woodside Energy Group Ltd | BNP Paribas | (138) |
| (1.565) | REA Group Ltd | BNP Paribas | (842) | (1.663) | Woodside Energy Group Ltd | Goldman Sachs | (409) |
| (870) | REA Group Ltd | Goldman Sachs | (468) | (397) | Woodside Energy Group Ltd | HSBC | (64) |
| (270) | REA Group Ltd | HSBC | 430 | 1.843 | Woolworths Group Ltd | Barclays Bank | (752) |
| (1.170) | Reece Ltd | Barclays Bank | 76 | 2.105 | Woolworths Group Ltd | BNP Paribas | (1.759) |
| (3.477) | Reece Ltd | BNP Paribas | (68) | 1.158 | Woolworths Group Ltd | Goldman Sachs | (968) |
| (1.040) | Reece Ltd | Goldman Sachs | (20) | 379 | Woolworths Group Ltd | HSBC | (270) |
| (3.532) | Reece Ltd | HSBC | 160 | (672) | Xero Ltd | Barclays Bank | (196) |
| 1.212 | Rio Tinto Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.539) | (545) | Xero Ltd | Goldman Sachs | (5.537) |
| 536 | Rio Tinto Ltd | Barclays Bank | (778) | (735) | Xero Ltd | HSBC | (8.015) |
| 1.447 | Rio Tinto Ltd | BNP Paribas | (1.837) | | | | (43.484) |
| 590 | Rio Tinto Ltd | Goldman Sachs | (749) | Österreich | | | |
| 333 | Rio Tinto Ltd | HSBC | (1.070) | (539) | Erste Group Bank AG | BNP Paribas | 339 |
| 1.163 | Rio Tinto Ltd | JP Morgan | (3.737) | (347) | Erste Group Bank AG | Goldman Sachs | 219 |
| (16.593) | Santos Ltd | Barclays Bank | 968 | 56 | OMV AG | Barclays Bank | (68) |
| (7.677) | Santos Ltd | BNP Paribas | (597) | 2.356 | OMV AG | BNP Paribas | (2.088) |
| (16.205) | Santos Ltd | Goldman Sachs | (1.260) | 603 | OMV AG | Goldman Sachs | (535) |
| (5.870) | SEEK Ltd | Barclays Bank | 2.890 | 139 | OMV AG | JP Morgan | (160) |
| (868) | SEEK Ltd | Goldman Sachs | 281 | (406) | Verbund AG | Bank of America Merrill Lynch | 2.709 |
| (2) | Sierra Rutile Holdings Ltd [†] | Bank of America Merrill Lynch | — | (1.249) | Verbund AG | Barclays Bank | 5.068 |
| 1.288 | Sonic Healthcare Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (876) | (466) | Verbund AG | BNP Paribas | 3.110 |
| 818 | Sonic Healthcare Ltd | Barclays Bank | (562) | (800) | Verbund AG | Citibank | 3.246 |
| 3.756 | Sonic Healthcare Ltd | BNP Paribas | (2.555) | 588 | voestalpine AG | Barclays Bank | (1.130) |
| 3.861 | Sonic Healthcare Ltd | Goldman Sachs | (2.627) | 584 | voestalpine AG | BNP Paribas | (935) |
| 9 | Sonic Healthcare Ltd | HSBC | (4) | | | | 9.775 |
| 16.084 | South32 Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.667) | Belgien | | | |
| 44.583 | South32 Ltd | Barclays Bank | (4.333) | (527) | Ageas SA | BNP Paribas | 1.773 |
| 44.920 | South32 Ltd | BNP Paribas | (4.657) | (264) | Ageas SA | HSBC | 837 |
| 1.099 | South32 Ltd | Citibank | (107) | 160 | Anheuser-Busch InBev SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.027) |
| 22.211 | South32 Ltd | Goldman Sachs | (2.302) | 472 | Anheuser-Busch InBev SA | Barclays Bank | (2.132) |
| 612 | South32 Ltd | JP Morgan | (127) | 3.438 | Anheuser-Busch InBev SA | BNP Paribas | (22.062) |
| 11.869 | Suncorp Group Ltd | Barclays Bank | 4.153 | 936 | Anheuser-Busch InBev SA | Goldman Sachs | (6.006) |
| 24.139 | Telstra Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 156 | 436 | Anheuser-Busch InBev SA | HSBC | (3.962) |
| 39.157 | Telstra Group Ltd | Barclays Bank | 507 | 286 | Anheuser-Busch InBev SA | JP Morgan | (2.599) |
| 60.875 | Telstra Group Ltd | BNP Paribas | 394 | (85) | Argenx SE | Bank of America Merrill Lynch | 672 |
| 38.545 | Telstra Group Ltd | Citibank | 448 | (774) | Argenx SE | Barclays Bank | 18.512 |
| 28.149 | Telstra Group Ltd | Goldman Sachs | 182 | (201) | Argenx SE | BNP Paribas | 1.588 |
| 22.990 | Telstra Group Ltd | HSBC | 447 | (21) | Argenx SE | Citibank | 502 |
| 32.214 | Telstra Group Ltd | JP Morgan | 687 | (67) | Argenx SE | Goldman Sachs | 529 |
| (30.654) | Transurban Group (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 1.788 | (66) | Argenx SE | HSBC | (225) |
| (4.862) | Transurban Group (Unit) | Barclays Bank | (472) | (544) | D'ieteren Group | Barclays Bank | 2.891 |
| (10.710) | Transurban Group (Unit) | BNP Paribas | 625 | (453) | D'ieteren Group | BNP Paribas | 2.418 |
| (23.883) | Transurban Group (Unit) | Goldman Sachs | 1.393 | (438) | D'ieteren Group | Citibank | 2.065 |
| (2.071) | Transurban Group (Unit) | HSBC | (201) | (510) | D'ieteren Group | Goldman Sachs | 2.723 |
| (1.087) | Transurban Group (Unit) | JP Morgan | (106) | (129) | D'ieteren Group | HSBC | 1.088 |
| (6.358) | Treasury Wine Estates Ltd | Barclays Bank | 6.715 | 276 | Elia Group SA | HSBC | (3.448) |
| (1.096) | Treasury Wine Estates Ltd | BNP Paribas | 1.186 | 26 | Groupe Bruxelles Lambert NV | Bank of America Merrill Lynch | (136) |
| (2.252) | Treasury Wine Estates Ltd | Goldman Sachs | 2.437 | 939 | Groupe Bruxelles Lambert NV | Barclays Bank | (4.692) |
| (3.354) | Treasury Wine Estates Ltd | JP Morgan | 3.955 | 1.932 | Groupe Bruxelles Lambert NV | BNP Paribas | (10.108) |
| 1.697 | Wesfarmers Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (4.574) | | | | |
| 766 | Wesfarmers Ltd | Barclays Bank | (1.578) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|---------------------------|--------------------------------------|-----------------|---|
| Belgien Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| 386 | Groupe Bruxelles Lambert NV | Goldman Sachs | (2.019) | (2.264) | Brookfield Asset Management Ltd 'A' | BNP Paribas | 2.377 |
| 23 | Groupe Bruxelles Lambert NV | HSBC | (199) | (1.087) | Brookfield Asset Management Ltd 'A' | Goldman Sachs | 1.141 |
| (747) | KBC Group NV | Barclays Bank | (551) | (946) | Brookfield Asset Management Ltd 'A' | HSBC | 1.966 |
| (155) | KBC Group NV | Goldman Sachs | 99 | 441 | Brookfield Corp | Citibank | (414) |
| (386) | KBC Group NV | HSBC | 1.195 | (1.296) | Brookfield Renewable Corp 'A' | Bank of America | 2.997 |
| 97 | Sofina SA | Citibank | (624) | 143 | BRP Inc | Merrill Lynch | (214) |
| 68 | Sofina SA | Goldman Sachs | (327) | 406 | BRP Inc | BNP Paribas | (608) |
| 1.486 | Solvay SA | Bank of America | (12.455) | 251 | BRP Inc | JP Morgan | (391) |
| 96 | Solvay SA | Merrill Lynch | (1.143) | (2.135) | CAE Inc | Bank of America | 1.082 |
| (136) | UCB SA | JP Morgan | 749 | (2.394) | CAE Inc | Merrill Lynch | 1.213 |
| (912) | UCB SA | BNP Paribas | 5.025 | (1.153) | Cameco Corp | Bank of America | 1.109 |
| (108) | UCB SA | Citibank | 701 | (3.910) | Cameco Corp | Merrill Lynch | 3.761 |
| (562) | UCB SA | Goldman Sachs | 3.096 | (427) | Cameco Corp | Citibank | 139 |
| (156) | UCB SA | JP Morgan | 403 | (4.992) | Cameco Corp | Goldman Sachs | 4.801 |
| (1.497) | Umicore SA | BNP Paribas | 5.035 | (610) | Cameco Corp | HSBC | 412 |
| (308) | Umicore SA | Goldman Sachs | 1.036 | (60) | Cameco Corp | JP Morgan | 41 |
| (369) | Umicore SA | HSBC | 1.501 | 486 | Canadian Apartment Properties (REIT) | BNP Paribas | (567) |
| (343) | Warehouses De Pauw CVA (REIT) | Bank of America | 125 | 1.111 | Canadian Imperial Bank of Commerce | Citibank | (226) |
| (364) | Warehouses De Pauw CVA (REIT) | Merrill Lynch | (126) | 3.112 | Canadian Imperial Bank of Commerce | JP Morgan | 2.582 |
| | | Goldman Sachs | (19.278) | 280 | Canadian National Railway Co | Bank of America | (1.984) |
| | | | | 1.889 | Canadian National Railway Co | BNP Paribas | (13.383) |
| | Kanada | | | 812 | Canadian National Railway Co | Citibank | (1.312) |
| (768) | Agnico Eagle Mines Ltd | Bank of America | 5.092 | 894 | Canadian National Railway Co | Goldman Sachs | (6.334) |
| (1.120) | Agnico Eagle Mines Ltd | Merrill Lynch | 7.425 | 527 | Canadian National Railway Co | HSBC | (3.010) |
| (383) | Agnico Eagle Mines Ltd | BNP Paribas | 550 | 299 | Canadian National Railway Co | JP Morgan | (1.708) |
| (1.145) | Agnico Eagle Mines Ltd | Citibank | 7.591 | (35) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Bank of America | 200 |
| (574) | Agnico Eagle Mines Ltd | Goldman Sachs | 4.724 | (5.022) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Merrill Lynch | 9.833 |
| (2.933) | Air Canada | HSBC | 4.724 | (661) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | BNP Paribas | 506 |
| (9.755) | Air Canada | Bank of America | (1.206) | (2.033) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Citibank | 11.642 |
| (572) | Air Canada | Merrill Lynch | (4.011) | (1.560) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Goldman Sachs | 5.143 |
| (15.880) | Algonquin Power & Utilities Corp | BNP Paribas | (101) | (333) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | HSBC | 1.098 |
| (9.833) | Algonquin Power & Utilities Corp | Bank of America | 4.780 | (134) | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | JP Morgan | 446 |
| (1.024) | Algonquin Power & Utilities Corp | Merrill Lynch | 2.960 | (587) | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | BNP Paribas | 1.952 |
| (13.170) | Algonquin Power & Utilities Corp | BNP Paribas | 308 | (536) | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | Goldman Sachs | 1.783 |
| (4.022) | Algonquin Power & Utilities Corp | Goldman Sachs | 1.949 | (328) | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | HSBC | 2.692 |
| 4.532 | AltaGas Ltd | JP Morgan | (965) | (32) | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | JP Morgan | 263 |
| 4.220 | AltaGas Ltd | Goldman Sachs | (682) | 2.596 | Canadian Utilities Ltd 'A' | BNP Paribas | (5.146) |
| 1.701 | ARC Resources Ltd | HSBC | (1.087) | 364 | Canadian Utilities Ltd 'A' | Citibank | (120) |
| 3.329 | ARC Resources Ltd | Bank of America | (2.126) | 364 | Canadian Utilities Ltd 'A' | Goldman Sachs | (722) |
| 6.659 | ARC Resources Ltd | Merrill Lynch | (4.253) | 675 | Canadian Utilities Ltd 'A' | HSBC | (1.388) |
| 5.410 | ARC Resources Ltd | BNP Paribas | (2.463) | (89) | CCL Industries Inc 'B' | Bank of America | 344 |
| 3.587 | ARC Resources Ltd | Goldman Sachs | (1.633) | (2.464) | CCL Industries Inc 'B' | Merrill Lynch | 9.516 |
| 516 | Bank of Montreal | JP Morgan | (2.296) | 352 | CGI Inc | BNP Paribas | 57 |
| 3.618 | Bank of Montreal | Bank of America | (16.097) | 434 | CGI Inc | Bank of America | 70 |
| 831 | Bank of Montreal | Merrill Lynch | (2.160) | 447 | CGI Inc | Merrill Lynch | 614 |
| 1.361 | Bank of Montreal | BNP Paribas | (6.055) | | | | |
| 147 | Bank of Montreal | Citibank | (442) | | | | |
| 432 | Bank of Montreal | Goldman Sachs | (1.300) | | | | |
| 335 | Bank of Nova Scotia | HSBC | (209) | | | | |
| (848) | BCE Inc | JP Morgan | 1.494 | | | | |
| (372) | BCE Inc | BNP Paribas | 355 | | | | |
| (88) | BCE Inc | Merrill Lynch | 173 | | | | |
| (353) | BCE Inc | Citibank | 695 | | | | |
| (1.277) | Brookfield Asset Management Ltd 'A' | HSBC | 1.341 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---|---------------------------|--------------------------|-------------------------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| 741 | CGI Inc | Goldman Sachs | 120 | (70) | Intact Financial Corp | Citibank | 237 |
| 160 | CGI Inc | JP Morgan | 464 | (236) | Intact Financial Corp | Goldman Sachs | 627 |
| 194 | Constellation Software Inc | Goldman Sachs | 7.718 | (241) | Intact Financial Corp | HSBC | 517 |
| (155) | Descartes Systems Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (46) | (312) | Intact Financial Corp | JP Morgan | 669 |
| (254) | Descartes Systems Group Inc | BNP Paribas | (75) | (1.956) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.594 |
| 375 | Dollarama Inc | Bank of America Merrill Lynch | (407) | (13.182) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | BNP Paribas | 10.743 |
| 597 | Dollarama Inc | BNP Paribas | (649) | (886) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Citibank | 247 |
| 932 | Dollarama Inc | Citibank | (178) | (22.662) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Goldman Sachs | 18.468 |
| 1.390 | Dollarama Inc | Goldman Sachs | (1.510) | (3.778) | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | HSBC | 5.658 |
| 309 | Dollarama Inc | JP Morgan | (265) | (3.153) | Keyera Corp | Bank of America Merrill Lynch | 5.046 |
| 1.703 | Element Fleet Management Corp | BNP Paribas | (606) | (6.808) | Keyera Corp | BNP Paribas | 10.896 |
| 4.136 | Element Fleet Management Corp | Citibank | (137) | (1.680) | Keyera Corp | Citibank | 530 |
| 782 | Element Fleet Management Corp | HSBC | 1.432 | (4.281) | Keyera Corp | Goldman Sachs | 6.852 |
| 2.622 | Element Fleet Management Corp | JP Morgan | 4.803 | (1.388) | Keyera Corp | HSBC | 774 |
| 555 | Empire Co Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (137) | 13.121 | Kinross Gold Corp | Bank of America Merrill Lynch | (8.959) |
| 805 | Empire Co Ltd 'A' | BNP Paribas | (198) | 424 | Loblaw Cos Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (965) |
| 1.686 | Empire Co Ltd 'A' | Citibank | 161 | 391 | Loblaw Cos Ltd | BNP Paribas | (890) |
| 7.279 | Empire Co Ltd 'A' | Goldman Sachs | (1.790) | 1.295 | Loblaw Cos Ltd | Goldman Sachs | (2.947) |
| 746 | Empire Co Ltd 'A' | HSBC | (200) | (1.444) | Lundin Mining Corp | Citibank | 258 |
| 956 | Enbridge Inc | BNP Paribas | (2.744) | (194) | Magna International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 732 |
| 2.442 | Enbridge Inc | Citibank | (2.546) | (253) | Magna International Inc | Citibank | 749 |
| 786 | Enbridge Inc | HSBC | (2.833) | (617) | Magna International Inc | Goldman Sachs | 2.328 |
| (84) | Fairfax Financial Holdings Ltd | Goldman Sachs | (1.066) | (769) | Magna International Inc | HSBC | 3.467 |
| (1.623) | First Quantum Minerals Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.576 | 18.902 | Manulife Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (10.131) |
| (1.302) | First Quantum Minerals Ltd | BNP Paribas | 3.671 | 22.523 | Manulife Financial Corp | BNP Paribas | (12.071) |
| (1.216) | First Quantum Minerals Ltd | Citibank | 1.277 | 3.957 | Manulife Financial Corp | Citibank | (988) |
| (1.083) | First Quantum Minerals Ltd | JP Morgan | 5.622 | 7.227 | Manulife Financial Corp | Goldman Sachs | (3.873) |
| 114 | FirstService Corp | Citibank | 310 | 789 | Manulife Financial Corp | HSBC | (857) |
| 140 | FirstService Corp | HSBC | 605 | 994 | Manulife Financial Corp | JP Morgan | (1.080) |
| 79 | FirstService Corp | JP Morgan | 355 | (190) | Metro Inc | Bank of America Merrill Lynch | 766 |
| (2.289) | Fortis Inc | Goldman Sachs | 7.781 | (1.304) | Metro Inc | Goldman Sachs | 5.256 |
| 183 | Franco-Nevada Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.334) | 457 | National Bank of Canada | Bank of America Merrill Lynch | (1.168) |
| 2.503 | Franco-Nevada Corp | BNP Paribas | (31.920) | 1.522 | National Bank of Canada | BNP Paribas | (3.889) |
| 763 | Franco-Nevada Corp | Citibank | (526) | 2.297 | National Bank of Canada | Goldman Sachs | (5.869) |
| 1.114 | Franco-Nevada Corp | Goldman Sachs | (14.207) | (6.017) | Northland Power Inc | BNP Paribas | 1.988 |
| 676 | Franco-Nevada Corp | HSBC | (8.993) | (945) | Northland Power Inc | Goldman Sachs | 312 |
| 334 | Franco-Nevada Corp | JP Morgan | (4.443) | (409) | Northland Power Inc | HSBC | 790 |
| 270 | George Weston Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.794) | (411) | Northland Power Inc | JP Morgan | 794 |
| (5.690) | GFL Environmental Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.799 | (235) | Nutrien Ltd | BNP Paribas | 1.859 |
| (9.122) | GFL Environmental Inc | BNP Paribas | 4.487 | (1.665) | Nutrien Ltd | Citibank | 10.201 |
| (609) | GFL Environmental Inc | Citibank | (32) | (182) | Nutrien Ltd | HSBC | 1.764 |
| (5.571) | GFL Environmental Inc | HSBC | (4.581) | (1.237) | Nuvei Corp | BNP Paribas | 3.742 |
| 9.465 | Great-West Lifeco Inc | BNP Paribas | 2.224 | (326) | Nuvei Corp | JP Morgan | 3.205 |
| 139 | Great-West Lifeco Inc | Goldman Sachs | 33 | 168 | Onex Corp | Bank of America Merrill Lynch | 274 |
| 8.436 | Hydro One Ltd | BNP Paribas | (5.203) | 1.822 | Onex Corp | Goldman Sachs | 2.970 |
| 12.476 | Hydro One Ltd | Goldman Sachs | (7.694) | 758 | Onex Corp | HSBC | 768 |
| 3.423 | Hydro One Ltd | HSBC | (2.312) | (2.598) | Open Text Corp | Citibank | (2.442) |
| 2.383 | iA Financial Corp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 752 | (10.841) | Pan American Silver Corp | Bank of America Merrill Lynch | 16.476 |
| 224 | iA Financial Corp Inc | Citibank | (120) | (5.370) | Pan American Silver Corp | BNP Paribas | 8.161 |
| 331 | iA Financial Corp Inc | Goldman Sachs | 105 | (6.591) | Pan American Silver Corp | Citibank | 717 |
| 402 | iA Financial Corp Inc | HSBC | (428) | (2.823) | Parkland Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.513 |
| 215 | iA Financial Corp Inc | JP Morgan | (229) | (2.631) | Parkland Corp | BNP Paribas | 1.410 |
| (5.748) | IGM Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 633 | (2.282) | Parkland Corp | Citibank | 3.066 |
| (258) | IGM Financial Inc | BNP Paribas | 28 | (2.063) | Parkland Corp | Goldman Sachs | 1.106 |
| (1.305) | Intact Financial Corp | BNP Paribas | 3.468 | (481) | Parkland Corp | HSBC | 74 |
| | | | | 1.100 | Pembina Pipeline Corp | BNP Paribas | (1.833) |
| | | | | 524 | Pembina Pipeline Corp | Citibank | (172) |
| | | | | 6.583 | Pembina Pipeline Corp | Goldman Sachs | (10.971) |
| | | | | 417 | Pembina Pipeline Corp | HSBC | (643) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|---------------------------|------------------------------|-----------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| 407 | Pembina Pipeline Corp | JP Morgan | (742) | (151) | TMX Group Ltd | Bank of America | |
| 977 | Power Corp of Canada | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (68) |
| | | Merrill Lynch | (556) | (685) | TMX Group Ltd | BNP Paribas | (307) |
| 4.787 | Power Corp of Canada | BNP Paribas | (2.724) | (99) | TMX Group Ltd | Citibank | (92) |
| 2.310 | Power Corp of Canada | Citibank | (331) | (564) | TMX Group Ltd | Goldman Sachs | (253) |
| 4.803 | Power Corp of Canada | Goldman Sachs | (2.733) | (309) | TMX Group Ltd | JP Morgan | (1.121) |
| 2.396 | Power Corp of Canada | HSBC | (976) | 782 | Toromont Industries Ltd | Bank of America | |
| 2.321 | Power Corp of Canada | JP Morgan | (946) | | | Merrill Lynch | (230) |
| (4.671) | Quebecor Inc 'B' | BNP Paribas | 4.664 | 634 | Toromont Industries Ltd | BNP Paribas | (186) |
| (1.307) | Quebecor Inc 'B' | Citibank | 1.574 | 28 | Toromont Industries Ltd | Goldman Sachs | (8) |
| (2.499) | Quebecor Inc 'B' | Goldman Sachs | 2.495 | 155 | Toromont Industries Ltd | HSBC | 183 |
| (652) | Quebecor Inc 'B' | HSBC | 584 | 97 | Toronto-Dominion Bank | BNP Paribas | (402) |
| (977) | RB Global Inc | Bank of America | | 192 | Toronto-Dominion Bank | HSBC | (713) |
| | | Merrill Lynch | (531) | 184 | Toronto-Dominion Bank | JP Morgan | (684) |
| (178) | RB Global Inc | BNP Paribas | (97) | 362 | Tourmaline Oil Corp | BNP Paribas | (146) |
| (3.977) | RB Global Inc | Citibank | 10.679 | 71 | Tourmaline Oil Corp | Citibank | (183) |
| (688) | RB Global Inc | Goldman Sachs | (374) | 992 | Tourmaline Oil Corp | Goldman Sachs | (401) |
| (538) | RB Global Inc | HSBC | 1.572 | 263 | West Fraser Timber Co Ltd | Goldman Sachs | (1.464) |
| (245) | Restaurant Brands International Inc | Bank of America | | 468 | West Fraser Timber Co Ltd | HSBC | (2.869) |
| | | Merrill Lynch | 34 | (708) | Wheaton Precious Metals Corp | Bank of America | |
| (1.467) | Restaurant Brands International Inc | BNP Paribas | 205 | | | Merrill Lynch | 4.252 |
| (906) | Restaurant Brands International Inc | Goldman Sachs | 126 | (268) | Wheaton Precious Metals Corp | BNP Paribas | 1.610 |
| (317) | Restaurant Brands International Inc | HSBC | (293) | (309) | Wheaton Precious Metals Corp | HSBC | 2.071 |
| (182) | Restaurant Brands International Inc | JP Morgan | (168) | (333) | WSP Global Inc | Bank of America | |
| (2.200) | Rogers Communications Inc 'B' | Bank of America | | (1.867) | WSP Global Inc | Merrill Lynch | 1.046 |
| | | Merrill Lynch | 9.724 | (663) | WSP Global Inc | BNP Paribas | 5.867 |
| (4.234) | Rogers Communications Inc 'B' | BNP Paribas | 18.713 | (84) | WSP Global Inc | Citibank | 1.232 |
| (6.047) | Rogers Communications Inc 'B' | Goldman Sachs | 26.727 | (109) | WSP Global Inc | Goldman Sachs | 264 |
| (3.219) | Rogers Communications Inc 'B' | HSBC | 14.156 | (170) | WSP Global Inc | HSBC | 587 |
| 612 | Royal Bank of Canada | Bank of America | | | | JP Morgan | 916 |
| | | Merrill Lynch | (3.707) | | | | 160.487 |
| 161 | Royal Bank of Canada | BNP Paribas | (975) | Dänemark | | | |
| 712 | Royal Bank of Canada | Citibank | (1.678) | 26 | AP Moller - Maersk A/S 'B' | BNP Paribas | (1.528) |
| 2.994 | Royal Bank of Canada | Goldman Sachs | (18.135) | 451 | Carlsberg AS 'B' | Bank of America | |
| (2.999) | Saputo Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (5.496) |
| | | Merrill Lynch | 2.180 | 472 | Carlsberg AS 'B' | Barclays Bank | (5.616) |
| (128) | Shopify Inc 'A' | Bank of America | | 120 | Carlsberg AS 'B' | BNP Paribas | (1.462) |
| | | Merrill Lynch | 343 | 274 | Carlsberg AS 'B' | Goldman Sachs | (3.339) |
| (2.032) | Shopify Inc 'A' | BNP Paribas | 5.445 | 81 | Carlsberg AS 'B' | HSBC | (842) |
| (559) | Shopify Inc 'A' | HSBC | 2.770 | 174 | Carlsberg AS 'B' | JP Morgan | (1.809) |
| 1.238 | Sun Life Financial Inc | Bank of America | | (82) | Coloplast A/S 'B' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (614) | | | Merrill Lynch | 421 |
| 3.393 | Sun Life Financial Inc | BNP Paribas | (1.681) | (1.337) | Coloplast A/S 'B' | Barclays Bank | 2.341 |
| 688 | Sun Life Financial Inc | Citibank | (634) | (598) | Coloplast A/S 'B' | BNP Paribas | 3.069 |
| 5.305 | Sun Life Financial Inc | Goldman Sachs | (2.629) | (558) | Coloplast A/S 'B' | Citibank | 206 |
| 4.164 | Sun Life Financial Inc | HSBC | 1.238 | (265) | Coloplast A/S 'B' | Goldman Sachs | 1.360 |
| 144 | Sun Life Financial Inc | JP Morgan | 43 | (370) | Coloplast A/S 'B' | HSBC | 5.655 |
| (4.010) | TC Energy Corp | Bank of America | | (17) | Coloplast A/S 'B' | JP Morgan | 260 |
| | | Merrill Lynch | 8.950 | 992 | Danske Bank A/S | Barclays Bank | (188) |
| (5.487) | TC Energy Corp | BNP Paribas | 12.247 | 1.415 | Danske Bank A/S | Citibank | (233) |
| (81) | TC Energy Corp | HSBC | 187 | (749) | Demant A/S | Bank of America | |
| (14.771) | TELUS Corp | BNP Paribas | 18.111 | | | Merrill Lynch | 1.170 |
| (198) | TELUS Corp | Goldman Sachs | 243 | (1.587) | Demant A/S | Barclays Bank | 5.529 |
| (2.183) | TELUS Corp | HSBC | 2.548 | (1.641) | Demant A/S | BNP Paribas | 2.564 |
| 448 | TFI International Inc | Bank of America | | (342) | Demant A/S | Goldman Sachs | 534 |
| | | Merrill Lynch | 289 | 139 | DSV A/S | Bank of America | |
| 212 | TFI International Inc | BNP Paribas | 137 | | | Merrill Lynch | 648 |
| 91 | TFI International Inc | Citibank | (222) | 515 | DSV A/S | Barclays Bank | (148) |
| 110 | TFI International Inc | Goldman Sachs | 71 | 548 | DSV A/S | BNP Paribas | 2.553 |
| 98 | TFI International Inc | JP Morgan | 230 | 57 | DSV A/S | Citibank | (16) |
| (946) | Thomson Reuters Corp | BNP Paribas | (2.966) | 63 | DSV A/S | Goldman Sachs | 294 |
| (973) | Thomson Reuters Corp | Goldman Sachs | (3.050) | 120 | DSV A/S | HSBC | 731 |
| | | | | 574 | Genmab A/S | BNP Paribas | (12.426) |
| | | | | 138 | Genmab A/S | Goldman Sachs | (2.987) |
| | | | | 754 | Novo Nordisk A/S 'B' | Barclays Bank | (6.702) |
| | | | | 1.263 | Novo Nordisk A/S 'B' | BNP Paribas | (8.003) |
| | | | | 105 | Novo Nordisk A/S 'B' | Citibank | (58) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|-------------------------|-----------------|---|-----------------------------|-------------------------|-----------------|---|
| Dänemark Fortsetzung | | | | Finnland Fortsetzung | | | |
| 127 | Novo Nordisk A/S 'B' | Goldman Sachs | (805) | (4.374) | Wartsila Oyj Abp | BNP Paribas | 2.475 |
| 409 | Novo Nordisk A/S 'B' | HSBC | (1.654) | | | | 36.768 |
| 2.226 | Novozymes A/S 'B' | BNP Paribas | (8.234) | Frankreich | | | |
| (889) | Orsted AS | Barclays Bank | 3.798 | (392) | Accor SA | Barclays Bank | 615 |
| (900) | Orsted AS | BNP Paribas | 6.219 | (4.761) | Accor SA | Goldman Sachs | 915 |
| (236) | Orsted AS | Citibank | 1.008 | (306) | Accor SA | HSBC | 278 |
| (209) | Orsted AS | HSBC | 282 | (318) | Accor SA | JP Morgan | 289 |
| 1.391 | Pandora A/S | BNP Paribas | (11.846) | (1.203) | Aeroports de Paris | Barclays Bank | 2.826 |
| 345 | Pandora A/S | Citibank | (1.376) | (1.306) | Air Liquide SA | Barclays Bank | 7.921 |
| 817 | Pandora A/S | Goldman Sachs | (6.957) | (156) | Air Liquide SA | Goldman Sachs | 630 |
| (348) | ROCKWOOL A/S 'B' | Barclays Bank | 5.463 | (1.500) | Alstom SA | Bank of America | |
| (163) | ROCKWOOL A/S 'B' | BNP Paribas | 1.881 | | | Merrill Lynch | (64) |
| (435) | Tryg A/S | Bank of America | | (2.236) | Alstom SA | Barclays Bank | 4.083 |
| | | Merrill Lynch | 97 | (262) | Alstom SA | Goldman Sachs | (11) |
| (1.348) | Tryg A/S | Barclays Bank | 386 | (4.066) | Alstom SA | HSBC | (8.032) |
| (8.151) | Tryg A/S | BNP Paribas | 1.811 | 286 | Amundi SA | Bank of America | |
| (425) | Tryg A/S | Goldman Sachs | 94 | | | Merrill Lynch | (2.764) |
| (1.869) | Tryg A/S | HSBC | (281) | 926 | Amundi SA | Barclays Bank | (5.586) |
| (939) | Vestas Wind Systems A/S | Bank of America | | 288 | Amundi SA | Goldman Sachs | (2.783) |
| | | Merrill Lynch | 1.014 | 725 | Amundi SA | HSBC | (6.154) |
| (1.421) | Vestas Wind Systems A/S | Barclays Bank | 1.901 | 769 | Arkema SA | Bank of America | |
| (6.207) | Vestas Wind Systems A/S | BNP Paribas | 6.701 | | | Merrill Lynch | (4.056) |
| (96) | Vestas Wind Systems A/S | Goldman Sachs | 104 | 557 | Arkema SA | Barclays Bank | (3.949) |
| (551) | Vestas Wind Systems A/S | HSBC | (449) | 104 | Arkema SA | Citibank | (737) |
| | | | (24.361) | 1.001 | Arkema SA | Goldman Sachs | (5.280) |
| Finnland | | | | 1.457 | Arkema SA | HSBC | (11.948) |
| 570 | Elisa Oyj | Bank of America | | 125 | Arkema SA | JP Morgan | (1.025) |
| | | Merrill Lynch | (2.045) | (522) | AXA SA | Goldman Sachs | 507 |
| 1.490 | Elisa Oyj | Barclays Bank | (3.862) | 9 | BioMerieux | Barclays Bank | (66) |
| 1.665 | Elisa Oyj | BNP Paribas | (5.973) | 336 | BioMerieux | Goldman Sachs | (1.571) |
| 893 | Elisa Oyj | Citibank | (1.865) | 461 | BioMerieux | HSBC | (2.136) |
| 232 | Elisa Oyj | Goldman Sachs | (832) | 1.271 | BNP Paribas SA | Goldman Sachs | (5.741) |
| 1.524 | Elisa Oyj | HSBC | (5.858) | 2.907 | Bollore SE | Bank of America | |
| 572 | Elisa Oyj | JP Morgan | (2.199) | | | Merrill Lynch | (419) |
| (3.662) | Fortum Oyj | Barclays Bank | 2.307 | 5.537 | Bollore SE | Barclays Bank | (473) |
| (1.904) | Fortum Oyj | BNP Paribas | 3.039 | 2.518 | Bollore SE | Goldman Sachs | (363) |
| (4.759) | Fortum Oyj | Goldman Sachs | 7.597 | 2.065 | Bollore SE | HSBC | (265) |
| (872) | Kesko Oyj 'B' | Barclays Bank | (17) | (1.305) | Bouygues SA | Bank of America | |
| (417) | Kone Oyj 'B' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 2.397 |
| | | Merrill Lynch | 1.496 | (3.451) | Bouygues SA | Barclays Bank | 1.806 |
| (1.363) | Kone Oyj 'B' | Barclays Bank | 3.435 | (3.805) | Bouygues SA | Citibank | 1.991 |
| (1.347) | Kone Oyj 'B' | BNP Paribas | 4.832 | (6.473) | Bouygues SA | Goldman Sachs | 11.888 |
| (937) | Kone Oyj 'B' | Goldman Sachs | 3.362 | (4.525) | Bouygues SA | HSBC | 9.905 |
| (734) | Kone Oyj 'B' | HSBC | 3.997 | 1.971 | Bureau Veritas SA | Bank of America | |
| (1.037) | Neste Oyj | BNP Paribas | 3.344 | | | Merrill Lynch | (1.515) |
| (328) | Neste Oyj | Citibank | 676 | 2.808 | Bureau Veritas SA | Barclays Bank | (2.608) |
| 11.703 | Nokia Oyj | Bank of America | | 357 | Bureau Veritas SA | Citibank | (332) |
| | | Merrill Lynch | 300 | 4.303 | Bureau Veritas SA | Goldman Sachs | (3.308) |
| 1.152 | Nokia Oyj | Barclays Bank | 4 | 3.072 | Bureau Veritas SA | HSBC | (6.068) |
| 9.286 | Nokia Oyj | BNP Paribas | 238 | 449 | Bureau Veritas SA | JP Morgan | (887) |
| 404 | Nokia Oyj | HSBC | 16 | 92 | Capgemini SE | Bank of America | |
| 3.996 | Nokia Oyj | JP Morgan | 158 | | | Merrill Lynch | 192 |
| 427 | Orion Oyj 'B' | Barclays Bank | (752) | 558 | Carrefour SA | Barclays Bank | (115) |
| 194 | Orion Oyj 'B' | HSBC | (723) | 1.666 | Cie de Saint-Gobain | Bank of America | |
| (209) | Sampo Oyj 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (3.344) |
| | | Merrill Lynch | 645 | 1.842 | Cie de Saint-Gobain | Barclays Bank | (4.817) |
| (904) | Sampo Oyj 'A' | Citibank | 19 | 1.618 | Cie de Saint-Gobain | Citibank | (4.062) |
| 146 | Stora Enso Oyj 'R' | Bank of America | | 2.402 | Cie de Saint-Gobain | Goldman Sachs | (4.822) |
| | | Merrill Lynch | 12 | 3.214 | Cie de Saint-Gobain | HSBC | (892) |
| 2.065 | Stora Enso Oyj 'R' | Barclays Bank | 551 | 749 | Cie de Saint-Gobain | JP Morgan | (208) |
| 885 | Stora Enso Oyj 'R' | Goldman Sachs | 71 | (3.302) | Cie Generale des | | |
| 1.718 | Stora Enso Oyj 'R' | HSBC | (495) | | Etablissements Michelin | Bank of America | |
| (671) | UPM-Kymmene Oyj | Bank of America | | | SCA | Merrill Lynch | 8.814 |
| | | Merrill Lynch | 831 | (4.627) | Cie Generale des | | |
| (3.761) | UPM-Kymmene Oyj | Barclays Bank | 4.070 | | Etablissements Michelin | | |
| (4.962) | UPM-Kymmene Oyj | BNP Paribas | 6.146 | (2.400) | SCA | Barclays Bank | 5.978 |
| (1.538) | UPM-Kymmene Oyj | Citibank | 1.708 | | | | |
| (4.977) | UPM-Kymmene Oyj | Goldman Sachs | 6.164 | | Cie Generale des | | |
| (1.343) | UPM-Kymmene Oyj | HSBC | 3.226 | | Etablissements Michelin | | |
| (279) | UPM-Kymmene Oyj | JP Morgan | 670 | | SCA | Citibank | 3.101 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--|-----------------|---|-------------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| (504) | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Goldman Sachs | 1.345 | 258 | La Francaise des Jeux SAEM | Goldman Sachs | (369) |
| (3.045) | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | HSBC | 8.713 | 6.483 | La Francaise des Jeux SAEM | HSBC | (10.106) |
| 12.252 | Credit Agricole SA | Barclays Bank | (15.568) | 351 | La Francaise des Jeux SAEM | JP Morgan | (547) |
| 7.125 | Credit Agricole SA | Goldman Sachs | (7.182) | 507 | Legrand SA | Bank of America | |
| 1.817 | Credit Agricole SA | HSBC | (784) | | | Merrill Lynch | 1.321 |
| 246 | Danone SA | Citibank | (58) | 156 | Legrand SA | Goldman Sachs | 406 |
| 184 | Danone SA | JP Morgan | (976) | 321 | Legrand SA | HSBC | 1.097 |
| 946 | Dassault Systemes SE | Barclays Bank | 2.015 | 57 | L'Oreal SA | Bank of America | |
| 1.831 | Dassault Systemes SE | HSBC | 10.411 | | | Merrill Lynch | (1.315) |
| (466) | Edenred | Barclays Bank | 50 | 202 | L'Oreal SA | Barclays Bank | (4.130) |
| (1.502) | Edenred | Citibank | 160 | 24 | L'Oreal SA | Citibank | (491) |
| 486 | Eiffage SA | Bank of America | | 95 | L'Oreal SA | Goldman Sachs | (2.191) |
| | | Merrill Lynch | (1.603) | 58 | L'Oreal SA | HSBC | (1.777) |
| 1.104 | Eiffage SA | Barclays Bank | (4.527) | 62 | L'Oreal SA | JP Morgan | (1.900) |
| 77 | Eiffage SA | Citibank | (316) | (13) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Bank of America | |
| 1.816 | Eiffage SA | Goldman Sachs | (5.992) | | | Merrill Lynch | 922 |
| 386 | Eiffage SA | HSBC | (2.325) | (103) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Barclays Bank | 6.984 |
| 476 | Eiffage SA | JP Morgan | (2.867) | (71) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Citibank | 4.045 |
| 1.975 | Engie SA | Bank of America | | (80) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Goldman Sachs | 5.672 |
| | | Merrill Lynch | (1.451) | (29) | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | HSBC | 2.161 |
| 806 | Engie SA | Barclays Bank | (291) | | | Barclays Bank | (5.337) |
| 9.393 | Engie SA | Goldman Sachs | (6.900) | 18.378 | Orange SA | Barclays Bank | |
| 501 | Engie SA | HSBC | (309) | 171 | Pernod Ricard SA | Bank of America | |
| (78) | EssilorLuxottica SA | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.337) |
| | | Merrill Lynch | 1.259 | 175 | Pernod Ricard SA | Barclays Bank | (2.261) |
| (767) | EssilorLuxottica SA | Barclays Bank | 8.310 | 1 | Pernod Ricard SA | Citibank | (13) |
| (195) | EssilorLuxottica SA | Citibank | 1.420 | 356 | Pernod Ricard SA | Goldman Sachs | (4.866) |
| (422) | EssilorLuxottica SA | Goldman Sachs | 6.813 | 173 | Pernod Ricard SA | HSBC | (2.882) |
| (129) | EssilorLuxottica SA | HSBC | 2.036 | 871 | Publicis Groupe SA | Barclays Bank | (2.213) |
| (414) | EssilorLuxottica SA | JP Morgan | 6.533 | 1.135 | Publicis Groupe SA | Goldman Sachs | 461 |
| 324 | Eurazeo SE | Bank of America | | 2.451 | Publicis Groupe SA | HSBC | (1.361) |
| | | Merrill Lynch | (35) | (466) | Remy Cointreau SA | Barclays Bank | 2.424 |
| 307 | Eurazeo SE | Barclays Bank | 34 | (383) | Remy Cointreau SA | Citibank | 2.974 |
| 346 | Eurazeo SE | Citibank | 659 | (58) | Remy Cointreau SA | Goldman Sachs | 864 |
| 4.252 | Eurazeo SE | HSBC | (6.583) | (701) | Remy Cointreau SA | HSBC | 14.745 |
| (359) | Eurofins Scientific SE | Bank of America | | (348) | Renault SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (744) | (2.075) | Renault SA | Merrill Lynch | 609 |
| (2.324) | Eurofins Scientific SE | Barclays Bank | (4.318) | (536) | Renault SA | Barclays Bank | 2.738 |
| (762) | Eurofins Scientific SE | Citibank | (1.416) | (2.826) | Renault SA | Citibank | 1.073 |
| (2.299) | Eurofins Scientific SE | Goldman Sachs | (4.762) | (1.026) | Renault SA | Goldman Sachs | 4.949 |
| (2.704) | Eurofins Scientific SE | HSBC | 7.333 | (492) | Sanofi | HSBC | 1.008 |
| (262) | Euronext NV | Bank of America | | (386) | Sanofi | Barclays Bank | 2.868 |
| | | Merrill Lynch | 2.042 | (1.679) | Sanofi | Citibank | 2.250 |
| (1.827) | Euronext NV | Goldman Sachs | 14.241 | (461) | Sanofi | Goldman Sachs | 8.677 |
| (1.114) | Getlink SE | Barclays Bank | 1.558 | (55) | Sartorius Stedim Biotech | HSBC | 2.668 |
| (1.660) | Getlink SE | Goldman Sachs | 1.604 | | | Bank of America | |
| (18.698) | Getlink SE | HSBC | 14.974 | (395) | Sartorius Stedim Biotech | Merrill Lynch | 29 |
| (821) | Getlink SE | JP Morgan | 657 | (146) | Sartorius Stedim Biotech | Barclays Bank | 195 |
| 31 | Hermes International | Bank of America | | (344) | Sartorius Stedim Biotech | Citibank | (75) |
| | | Merrill Lynch | (2.218) | (31) | Sartorius Stedim Biotech | Goldman Sachs | 184 |
| 175 | Hermes International | Barclays Bank | (20.610) | 304 | Schneider Electric SE | HSBC | 278 |
| 16 | Hermes International | Citibank | (1.884) | | | Bank of America | |
| 3 | Hermes International | Goldman Sachs | (215) | 687 | Schneider Electric SE | Merrill Lynch | 1.461 |
| 45 | Hermes International | HSBC | (4.675) | 146 | Schneider Electric SE | Barclays Bank | (1.819) |
| 21 | Hermes International | JP Morgan | (2.182) | | | Citibank | (387) |
| 887 | Ipsen SA | HSBC | (3.599) | 1.152 | Schneider Electric SE | Goldman Sachs | 5.535 |
| 23 | Kering SA | Bank of America | | 162 | Schneider Electric SE | HSBC | 720 |
| | | Merrill Lynch | (1.308) | 203 | Schneider Electric SE | JP Morgan | 902 |
| 102 | Kering SA | Barclays Bank | (4.776) | (83) | SEB SA | Bank of America | |
| 9 | Kering SA | Citibank | (421) | (789) | SEB SA | Merrill Lynch | 1.453 |
| 136 | Kering SA | Goldman Sachs | (7.733) | (125) | SEB SA | Barclays Bank | 12.721 |
| 22 | Kering SA | HSBC | (1.559) | (504) | SEB SA | Citibank | 2.015 |
| 796 | La Francaise des Jeux SAEM | Bank of America | | (335) | SEB SA | Goldman Sachs | 8.826 |
| | | Merrill Lynch | (1.139) | 127 | Societe Generale SA | HSBC | 5.401 |
| 71 | La Francaise des Jeux SAEM | Barclays Bank | (156) | | | Barclays Bank | (221) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
|-------------------------------|------------------------------------|-----------------|--|--------------------------------|--------------------------|-----------------|--|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| 2.511 | Societe Generale SA | Goldman Sachs | (1.475) | (249) | Bechtle AG | HSBC | 1.500 |
| (388) | Sodexo SA | HSBC | (1.781) | 272 | Beiersdorf AG | Bank of America | |
| 2.596 | STMicroelectronics NV | Barclays Bank | (1.946) | | | Merrill Lynch | (1.960) |
| 652 | STMicroelectronics NV | Goldman Sachs | 1.566 | 692 | Beiersdorf AG | Barclays Bank | (4.877) |
| 259 | STMicroelectronics NV | HSBC | 640 | 436 | Beiersdorf AG | BNP Paribas | (3.142) |
| (162) | Teleperformance | Bank of America | | 56 | Beiersdorf AG | Citibank | (395) |
| | | Merrill Lynch | 3.632 | 721 | Beiersdorf AG | Goldman Sachs | (5.196) |
| (63) | Teleperformance | Barclays Bank | 1.359 | 380 | Beiersdorf AG | HSBC | (2.597) |
| (60) | Teleperformance | Citibank | 1.294 | (183) | Brenntag SE | Bank of America | |
| (37) | Teleperformance | HSBC | 668 | | | Merrill Lynch | 543 |
| 2.501 | TotalEnergies SE | Barclays Bank | (8.652) | (577) | Brenntag SE | Goldman Sachs | 1.713 |
| (545) | Valeo | Bank of America | | (321) | Brenntag SE | HSBC | 555 |
| | | Merrill Lynch | 38 | (399) | Carl Zeiss Meditec AG | Barclays Bank | 1.125 |
| (482) | Valeo | HSBC | (522) | (5.513) | Commerzbank AG | Bank of America | |
| 415 | Veolia Environnement SA | Barclays Bank | 325 | | | Merrill Lynch | 3.232 |
| 205 | Vinci SA | Bank of America | | (5.137) | Commerzbank AG | BNP Paribas | 3.011 |
| | | Merrill Lynch | (508) | (850) | Commerzbank AG | Citibank | 430 |
| 195 | Vinci SA | Barclays Bank | (708) | (1.967) | Continental AG | BNP Paribas | 8.569 |
| 406 | Vinci SA | Goldman Sachs | (1.006) | (76) | Continental AG | Goldman Sachs | 331 |
| 3.104 | Vivendi SE | Barclays Bank | (3.666) | (346) | Covestro AG | Bank of America | |
| 4.424 | Vivendi SE | Citibank | (5.224) | | | Merrill Lynch | 1.082 |
| 761 | Vivendi SE | JP Morgan | (1.170) | (1.422) | Covestro AG | Barclays Bank | 4.737 |
| 2.474 | Wendel SE | Barclays Bank | (9.246) | (2.875) | Covestro AG | BNP Paribas | 8.994 |
| (1.210) | Worldline SA | Barclays Bank | 5.969 | (787) | Covestro AG | Citibank | 2.622 |
| (90) | Worldline SA | Citibank | 444 | (2.016) | Covestro AG | Goldman Sachs | 6.307 |
| (2.176) | Worldline SA | HSBC | 8.434 | (151) | Covestro AG | HSBC | 571 |
| | | | (9.077) | (618) | Daimler Truck Holding AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 416 |
| | | | | (377) | Daimler Truck Holding AG | Citibank | 346 |
| (159) | adidas AG | Bank of America | | (1.690) | Daimler Truck Holding AG | Goldman Sachs | 1.137 |
| | | Merrill Lynch | 2.346 | (375) | Delivery Hero SE | Bank of America | |
| (543) | adidas AG | Barclays Bank | 5.717 | | | Merrill Lynch | 1.822 |
| (432) | adidas AG | BNP Paribas | 6.375 | (403) | Delivery Hero SE | Barclays Bank | 676 |
| (636) | adidas AG | Citibank | 4.684 | (1.620) | Delivery Hero SE | BNP Paribas | 7.870 |
| (203) | adidas AG | Goldman Sachs | 2.996 | (184) | Delivery Hero SE | Goldman Sachs | 894 |
| (288) | adidas AG | HSBC | 5.332 | 2.231 | Deutsche Bank AG Reg | BNP Paribas | (562) |
| 172 | Allianz SE Reg | Bank of America | | 258 | Deutsche Bank AG Reg | Goldman Sachs | (65) |
| | | Merrill Lynch | (1.745) | 4.169 | Deutsche Bank AG Reg | HSBC | (837) |
| 50 | Allianz SE Reg | Barclays Bank | (563) | 531 | Deutsche Bank AG Reg | JP Morgan | (107) |
| 495 | Allianz SE Reg | BNP Paribas | (5.021) | (386) | Deutsche Boerse AG | Barclays Bank | 1.865 |
| 255 | Allianz SE Reg | Citibank | (2.872) | (56) | Deutsche Boerse AG | BNP Paribas | 532 |
| 64 | Allianz SE Reg | Goldman Sachs | (649) | (69) | Deutsche Boerse AG | HSBC | 900 |
| 129 | Allianz SE Reg | JP Morgan | (2.197) | (2.538) | Deutsche Lufthansa AG | | |
| (2.240) | Aroundtown SA | Bank of America | | | Reg | Barclays Bank | 1.314 |
| | | Merrill Lynch | 264 | (4.204) | Deutsche Lufthansa AG | | |
| (31.389) | Aroundtown SA | Barclays Bank | 835 | | Reg | BNP Paribas | (247) |
| (12.648) | Aroundtown SA | BNP Paribas | 1.491 | (992) | Deutsche Lufthansa AG | | |
| (17.752) | Aroundtown SA | Citibank | 1.315 | | Reg | Goldman Sachs | (58) |
| (6.499) | Aroundtown SA | Goldman Sachs | 766 | 791 | Deutsche Post AG Reg | Bank of America | |
| (1.936) | Aroundtown SA | HSBC | 305 | | | Merrill Lynch | 1.339 |
| 226 | BASF SE | Bank of America | | 10.998 | Deutsche Post AG Reg | BNP Paribas | 18.613 |
| | | Merrill Lynch | (706) | 5.579 | Deutsche Post AG Reg | Goldman Sachs | 9.442 |
| 231 | BASF SE | Barclays Bank | (613) | 1.093 | Deutsche Post AG Reg | HSBC | 502 |
| 618 | BASF SE | BNP Paribas | (1.930) | 2.013 | E.ON SE | Bank of America | |
| 389 | BASF SE | Citibank | (1.032) | | | Merrill Lynch | (1.537) |
| (540) | Bayer AG Reg | Barclays Bank | 589 | 2.456 | E.ON SE | Barclays Bank | 73 |
| (174) | Bayer AG Reg | BNP Paribas | 108 | 13.628 | E.ON SE | BNP Paribas | (10.404) |
| (194) | Bayer AG Reg | Citibank | 273 | 1.811 | E.ON SE | Goldman Sachs | (1.383) |
| (717) | Bayer AG Reg | Goldman Sachs | 444 | 7.797 | E.ON SE | HSBC | (6.286) |
| (382) | Bayer AG Reg | HSBC | 2.280 | (1.311) | Evonik Industries AG | Goldman Sachs | 1.120 |
| (188) | Bayerische Motoren Werke AG (Pref) | Bank of America | | (3.326) | Fresenius Medical Care | | |
| | | Merrill Lynch | (301) | | AG & Co KGaA | Barclays Bank | 9.837 |
| (1.166) | Bayerische Motoren Werke AG (Pref) | BNP Paribas | (1.867) | (3.045) | Fresenius Medical Care | | |
| | | | | | AG & Co KGaA | BNP Paribas | 12.290 |
| (143) | Bechtle AG | Bank of America | | (1.052) | Fresenius Medical Care | | |
| | | Merrill Lynch | 302 | | AG & Co KGaA | Goldman Sachs | 4.246 |
| (236) | Bechtle AG | Barclays Bank | 577 | (355) | Fresenius Medical Care | | |
| (1.354) | Bechtle AG | BNP Paribas | 2.863 | | AG & Co KGaA | HSBC | 986 |
| (921) | Bechtle AG | Citibank | 955 | (1.035) | Fresenius SE & Co KGaA | Barclays Bank | 1.945 |
| (719) | Bechtle AG | Goldman Sachs | 1.520 | (4.068) | Fresenius SE & Co KGaA | BNP Paribas | 9.295 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|--------------------------|-----------------|---|--------------------------------|-------------------------|-----------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| (1.084) | Fresenius SE & Co KGaA | Citibank | 2.037 | 179 | Muenchener | | |
| (772) | Fresenius SE & Co KGaA | Goldman Sachs | 1.764 | | Rueckversicherungs- | | |
| 5.516 | GEA Group AG | BNP Paribas | (7.480) | | Gesellschaft AG in | | |
| 307 | GEA Group AG | Goldman Sachs | (416) | | Muenchen Reg | Goldman Sachs | 2.848 |
| (201) | Hannover Rueck SE | Barclays Bank | (1.331) | 99 | Muenchener | | |
| (691) | Hannover Rueck SE | BNP Paribas | (8.337) | | Rueckversicherungs- | | |
| (108) | Hannover Rueck SE | Citibank | (715) | | Gesellschaft AG in | | |
| (381) | Hannover Rueck SE | Goldman Sachs | (4.597) | | Muenchen Reg | HSBC | 1.047 |
| (114) | Hannover Rueck SE | HSBC | (1.442) | 27 | Muenchener | | |
| 146 | Heidelberg Materials AG | Bank of America | | | Rueckversicherungs- | | |
| | | Merrill Lynch | (253) | | Gesellschaft AG in | | |
| 815 | Heidelberg Materials AG | Barclays Bank | (3.028) | | Muenchen Reg | JP Morgan | 285 |
| 821 | Heidelberg Materials AG | BNP Paribas | (1.420) | 1.732 | Nemetschek SE | BNP Paribas | 9.062 |
| 376 | Heidelberg Materials AG | Citibank | (1.397) | (664) | Puma SE | Barclays Bank | 231 |
| 719 | Heidelberg Materials AG | Goldman Sachs | (1.244) | (202) | Puma SE | BNP Paribas | 1.408 |
| 495 | Heidelberg Materials AG | HSBC | (1.638) | (858) | Puma SE | Citibank | 2.055 |
| 143 | Heidelberg Materials AG | JP Morgan | (473) | (995) | Puma SE | Goldman Sachs | 6.938 |
| (448) | HelloFresh SE | Barclays Bank | (125) | (205) | Puma SE | JP Morgan | 1.714 |
| (419) | HelloFresh SE | Citibank | (159) | 30 | Rational AG | Bank of America | |
| 331 | Henkel AG & Co KGaA | | | | | Merrill Lynch | (160) |
| | (Pref) | Barclays Bank | (1.039) | 62 | Rational AG | Barclays Bank | (232) |
| 809 | Henkel AG & Co KGaA | | | 67 | Rational AG | BNP Paribas | (358) |
| | (Pref) | BNP Paribas | (2.280) | 17 | Rational AG | Citibank | (64) |
| 637 | Henkel AG & Co KGaA | | | 8 | Rational AG | Goldman Sachs | (43) |
| | (Pref) | Goldman Sachs | (1.796) | 41 | Rational AG | HSBC | (832) |
| 292 | Henkel AG & Co KGaA | | | 59 | Rational AG | JP Morgan | (1.197) |
| | (Pref) | HSBC | 131 | 837 | SAP SE | Bank of America | |
| 1.332 | Infineon Technologies AG | Barclays Bank | 1.102 | | | Merrill Lynch | 1.644 |
| 976 | Infineon Technologies AG | BNP Paribas | 1.636 | 304 | SAP SE | Barclays Bank | (493) |
| 1.739 | Infineon Technologies AG | Citibank | (215) | 432 | SAP SE | BNP Paribas | 849 |
| (1.332) | LEG Immobilien SE | Bank of America | | 498 | SAP SE | Goldman Sachs | 978 |
| | | Merrill Lynch | 8.391 | (131) | Sartorius AG (Pref) | Bank of America | |
| (779) | LEG Immobilien SE | Barclays Bank | 3.194 | | | Merrill Lynch | 3.693 |
| (315) | LEG Immobilien SE | BNP Paribas | 1.984 | (147) | Sartorius AG (Pref) | Barclays Bank | 1.758 |
| (625) | LEG Immobilien SE | Citibank | 2.563 | (339) | Sartorius AG (Pref) | BNP Paribas | 9.556 |
| (715) | LEG Immobilien SE | Goldman Sachs | 4.504 | (28) | Sartorius AG (Pref) | Citibank | 264 |
| (667) | LEG Immobilien SE | HSBC | 4.587 | (100) | Sartorius AG (Pref) | Goldman Sachs | 2.819 |
| 351 | Mercedes-Benz Group AG | Bank of America | | 549 | Scout24 SE | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 847 | | | Merrill Lynch | 610 |
| 4.371 | Mercedes-Benz Group AG | Barclays Bank | (5.321) | 1.007 | Scout24 SE | Barclays Bank | (194) |
| 122 | Mercedes-Benz Group AG | BNP Paribas | 294 | 552 | Scout24 SE | BNP Paribas | 613 |
| 2 | Mercedes-Benz Group AG | Citibank | (2) | 181 | Scout24 SE | Citibank | (35) |
| 432 | Mercedes-Benz Group AG | Goldman Sachs | 1.042 | 689 | Scout24 SE | Goldman Sachs | 765 |
| (327) | Merck KGaA | Bank of America | | 793 | Scout24 SE | HSBC | 1.880 |
| | | Merrill Lynch | 646 | 225 | Scout24 SE | JP Morgan | 533 |
| (13) | Merck KGaA | Barclays Bank | 43 | 1.002 | Siemens AG Reg | Barclays Bank | (1.851) |
| (680) | Merck KGaA | BNP Paribas | 1.343 | 101 | Siemens AG Reg | BNP Paribas | 356 |
| (127) | Merck KGaA | Citibank | 420 | 1.195 | Siemens AG Reg | Citibank | (3.674) |
| (187) | Merck KGaA | Goldman Sachs | 369 | 204 | Siemens AG Reg | HSBC | 893 |
| (219) | Merck KGaA | HSBC | (386) | (3.662) | Siemens Energy AG | Barclays Bank | 2.111 |
| (109) | MTU Aero Engines AG | Barclays Bank | 1.443 | (8) | Siemens Energy AG | BNP Paribas | (6) |
| (41) | MTU Aero Engines AG | HSBC | 359 | (193) | Siemens Healthineers AG | Barclays Bank | 165 |
| 48 | Muenchener | | | (4.267) | Siemens Healthineers AG | BNP Paribas | 8.110 |
| | Rueckversicherungs- | | | (213) | Siemens Healthineers AG | Citibank | 182 |
| | Gesellschaft AG in | Bank of America | | (436) | Siemens Healthineers AG | Goldman Sachs | 829 |
| | Muenchen Reg | Merrill Lynch | 764 | (137) | Symrise AG | Barclays Bank | 680 |
| 173 | Muenchener | | | (390) | Symrise AG | BNP Paribas | 3.061 |
| | Rueckversicherungs- | | | (223) | Symrise AG | Goldman Sachs | 1.750 |
| | Gesellschaft AG in | | | (835) | Symrise AG | HSBC | 7.712 |
| | Muenchen Reg | Barclays Bank | 1.252 | (13) | Symrise AG | JP Morgan | 120 |
| 297 | Muenchener | | | (1.095) | Telefonica Deutschland | Bank of America | |
| | Rueckversicherungs- | | | | Holding AG | Merrill Lynch | 531 |
| | Gesellschaft AG in | | | (15.702) | Telefonica Deutschland | | |
| | Muenchen Reg | BNP Paribas | 4.725 | | Holding AG | Barclays Bank | 2.180 |
| 28 | Muenchener | | | (9.337) | Telefonica Deutschland | | |
| | Rueckversicherungs- | | | (9.062) | Holding AG | BNP Paribas | 4.526 |
| | Gesellschaft AG in | | | | Holding AG | Goldman Sachs | 4.393 |
| | Muenchen Reg | Citibank | 300 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|---------------------------|--|-----------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Irland Fortsetzung | | | |
| (4.169) | Vonovia SE | Barclays Bank | 2.893 | 1.411 | CRH Plc | Bank of America | |
| (8.659) | Vonovia SE | BNP Paribas | 14.978 | | | Merrill Lynch | (1.281) |
| (2.918) | Vonovia SE | Goldman Sachs | 5.047 | 3.388 | CRH Plc | Barclays Bank | (5.897) |
| (1.871) | Vonovia SE | HSBC | 3.037 | 3.475 | CRH Plc | BNP Paribas | (3.154) |
| (1.451) | Zalando SE | Bank of America | | 1.369 | CRH Plc | Citibank | (2.383) |
| | | Merrill Lynch | 7.189 | 2.599 | CRH Plc | Goldman Sachs | (2.359) |
| (1.181) | Zalando SE | Goldman Sachs | 5.851 | 1.209 | CRH Plc | HSBC | (581) |
| | | | 235.621 | 883 | CRH Plc | JP Morgan | (424) |
| | | | | (254) | Flutter Entertainment Plc | Barclays Bank | 2.373 |
| | | | | (86) | Flutter Entertainment Plc | BNP Paribas | 225 |
| 11.800 | AIA Group Ltd | Barclays Bank | (7.305) | (324) | Flutter Entertainment Plc | Goldman Sachs | 848 |
| 55.000 | BOC Hong Kong Holdings Ltd | Bank of America | | (439) | Flutter Entertainment Plc | HSBC | (937) |
| | | Merrill Lynch | (9.829) | 102 | Kerry Group Plc 'A' | Barclays Bank | (416) |
| (40.200) | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | Citibank | 6.517 | (550) | Kingspan Group Plc | Bank of America | |
| 63.000 | CK Asset Holdings Ltd | HSBC | (34.580) | | | Merrill Lynch | 24 |
| 9.000 | CK Hutchison Holdings Ltd | Bank of America | | (1.689) | Kingspan Group Plc | Barclays Bank | 3.174 |
| | | Merrill Lynch | (5.744) | (717) | Kingspan Group Plc | BNP Paribas | 31 |
| 8.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | Barclays Bank | (3.960) | (292) | Kingspan Group Plc | Goldman Sachs | 12 |
| 12.000 | CK Hutchison Holdings Ltd | BNP Paribas | (7.659) | (434) | Kingspan Group Plc | HSBC | (454) |
| 12.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | Goldman Sachs | (7.978) | 602 | Smurfit Kappa Group Plc | Bank of America | |
| 10.000 | CK Hutchison Holdings Ltd | HSBC | (8.233) | | | Merrill Lynch | (701) |
| (9.600) | ESR Group Ltd | Goldman Sachs | 172 | 579 | Smurfit Kappa Group Plc | Barclays Bank | (785) |
| (6.000) | Galaxy Entertainment Group Ltd | BNP Paribas | 2.604 | 430 | Smurfit Kappa Group Plc | BNP Paribas | (500) |
| (10.000) | Galaxy Entertainment Group Ltd | Citibank | 4.531 | 132 | Smurfit Kappa Group Plc | Goldman Sachs | (154) |
| (27.000) | Galaxy Entertainment Group Ltd | Goldman Sachs | 11.718 | 385 | Smurfit Kappa Group Plc | HSBC | (428) |
| (13.000) | Hang Lung Properties Ltd | Goldman Sachs | 1.128 | | | | (4.625) |
| (1.700) | Hang Seng Bank Ltd | BNP Paribas | 1.953 | 1.911 | Bank Hapoalim BM | Bank of America | |
| (1.300) | Hang Seng Bank Ltd | HSBC | 1.726 | | | Merrill Lynch | (1.150) |
| 84.000 | Henderson Land Development Co Ltd | Goldman Sachs | (31.632) | 3.348 | Bank Hapoalim BM | Barclays Bank | (1.484) |
| (141.000) | HKT Trust & HKT Ltd (Unit) | Bank of America | | 3.844 | Bank Hapoalim BM | Goldman Sachs | (2.313) |
| | | Merrill Lynch | 3.600 | 684 | Bank Leumi Le-Israel BM | Barclays Bank | (343) |
| (258.900) | Hong Kong & China Gas Co Ltd | Barclays Bank | 10.906 | 3.631 | Bank Leumi Le-Israel BM | Goldman Sachs | (2.585) |
| (900) | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | Goldman Sachs | 3.079 | 14.920 | Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd | Bank of America | |
| (92.452) | MTR Corp Ltd | Barclays Bank | 32.454 | | | Merrill Lynch | (882) |
| (5.000) | New World Development Co Ltd | Goldman Sachs | 957 | 31.467 | Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd | Barclays Bank | (2.029) |
| (28.800) | Sands China Ltd | Goldman Sachs | 4.044 | 23.582 | Israel Discount Bank Ltd 'A' | Goldman Sachs | (5.765) |
| (1) | Sisram Medical Ltd ^{tr} | JP Morgan | — | | | | (16.551) |
| 4.000 | SITC International Holdings Co Ltd | Citibank | 122 | (761) | Amplifon SpA | Barclays Bank | 1.308 |
| 35.500 | Sun Hung Kai Properties Ltd | Bank of America | | (4.414) | Amplifon SpA | BNP Paribas | 15.977 |
| | | Merrill Lynch | (24.470) | (822) | Amplifon SpA | Goldman Sachs | 2.975 |
| 2.000 | Sun Hung Kai Properties Ltd | Goldman Sachs | (1.379) | (1.257) | Amplifon SpA | HSBC | 4.711 |
| 21.000 | Swire Pacific Ltd 'A' | HSBC | (25.600) | 641 | Assicurazioni Generali SpA | Barclays Bank | (216) |
| (40.400) | Swire Properties Ltd | Bank of America | | 484 | Assicurazioni Generali SpA | Goldman Sachs | (587) |
| | | Merrill Lynch | 11.036 | 354 | Assicurazioni Generali SpA | HSBC | (476) |
| (2.500) | Techtronic Industries Co Ltd | Barclays Bank | 2.058 | (665) | CNH Industrial NV | Citibank | 525 |
| (4.000) | Techtronic Industries Co Ltd | BNP Paribas | 5.157 | (2.098) | Davide Campari-Milano NV | Bank of America | |
| (4.000) | Techtronic Industries Co Ltd | Goldman Sachs | 5.157 | | | Merrill Lynch | 101 |
| (33.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Citibank | 7.161 | (11.623) | Davide Campari-Milano NV | Barclays Bank | 2.358 |
| (15.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | BNP Paribas | 3.332 | (5.393) | Davide Campari-Milano NV | BNP Paribas | 259 |
| (15.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | Goldman Sachs | 3.332 | (7.585) | Davide Campari-Milano NV | Citibank | 1.539 |
| (8.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | HSBC | 2.390 | (4.665) | Davide Campari-Milano NV | Goldman Sachs | 224 |
| | | | (43.235) | (4.713) | Davide Campari-Milano NV | HSBC | 428 |
| | | | | (187) | DiaSorin SpA | Bank of America | |
| (15.493) | AIB Group Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.464 |
| | | Merrill Lynch | 2.018 | (508) | DiaSorin SpA | Barclays Bank | 2.783 |
| (9.013) | AIB Group Plc | Barclays Bank | 1.463 | (278) | DiaSorin SpA | BNP Paribas | 2.176 |
| (37.691) | AIB Group Plc | BNP Paribas | 4.910 | (94) | DiaSorin SpA | Citibank | 515 |
| (2.762) | AIB Group Plc | Goldman Sachs | 360 | (473) | DiaSorin SpA | Goldman Sachs | 3.702 |
| (4.578) | AIB Group Plc | HSBC | 391 | (189) | DiaSorin SpA | HSBC | 874 |
| | | | | (94) | DiaSorin SpA | JP Morgan | 435 |
| | | | | 5.237 | Enel SpA | Barclays Bank | (867) |
| | | | | 23.942 | Enel SpA | BNP Paribas | (3.426) |
| | | | | 4.059 | Enel SpA | Goldman Sachs | (581) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|--|-------------------------------|---|----------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Italien Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| 21.208 | Eni SpA | BNP Paribas | (18.071) | (6.596) | Tenaris SA | Goldman Sachs | 3.345 |
| 220 | Ferrari NV | BNP Paribas | (376) | (8.626) | Terna - Rete Elettrica Nazionale | Barclays Bank | 276 |
| 73 | Ferrari NV | Goldman Sachs | (125) | (1.651) | Terna - Rete Elettrica Nazionale | HSBC | 138 |
| (931) | FinecoBank Banca Fineco SpA | Barclays Bank | (231) | 587 | UniCredit SpA | Barclays Bank | (595) |
| (41.555) | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | BNP Paribas | 6.656 | 604 | UniCredit SpA | BNP Paribas | (399) |
| (5.641) | Intesa Sanpaolo SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.506 | 562 | UniCredit SpA | Citibank | (570) |
| (28.433) | Intesa Sanpaolo SpA | Citibank | 5.176 | | | | 45.951 |
| 16.761 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Bank of America Merrill Lynch | 9.467 | Japan | | | |
| 3.168 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Barclays Bank | 254 | (200) | Advantest Corp | Barclays Bank | (5.108) |
| 2.623 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | BNP Paribas | 1.482 | (200) | Advantest Corp | Goldman Sachs | (8.233) |
| 5.612 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Citibank | 449 | (4.400) | Aeon Co Ltd | Barclays Bank | 4.285 |
| 9.821 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Goldman Sachs | 5.547 | (2.500) | Aeon Co Ltd | BNP Paribas | 767 |
| 4.468 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | HSBC | 1.312 | (1.900) | Aeon Co Ltd | Citibank | 1.850 |
| 358 | Moncler SpA | Bank of America Merrill Lynch | (864) | (600) | Aeon Co Ltd | Goldman Sachs | 184 |
| 830 | Moncler SpA | Barclays Bank | (1.205) | (1.000) | AGC Inc | HSBC | (146) |
| 905 | Moncler SpA | BNP Paribas | (2.184) | 1.000 | AGC Inc | BNP Paribas | 571 |
| (3.900) | Nexi SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.616 | (1.600) | Aisin Corp | Barclays Bank | (114) |
| (13.763) | Nexi SpA | Barclays Bank | 6.936 | (900) | Aisin Corp | BNP Paribas | (482) |
| (17.234) | Nexi SpA | BNP Paribas | 7.140 | (500) | Aisin Corp | Citibank | (36) |
| (4.856) | Nexi SpA | Goldman Sachs | 2.012 | (700) | Aisin Corp | Goldman Sachs | (375) |
| (4.000) | Nexi SpA | HSBC | 683 | (600) | Aisin Corp | HSBC | (342) |
| (1.426) | Nexi SpA | JP Morgan | 244 | (500) | Aisin Corp | JP Morgan | (285) |
| 790 | Poste Italiane SpA | Bank of America Merrill Lynch | 61 | 700 | Ajinomoto Co Inc | BNP Paribas | 1.633 |
| 2.237 | Poste Italiane SpA | Barclays Bank | (401) | 3.900 | Ajinomoto Co Inc | Goldman Sachs | 9.099 |
| 13.173 | Poste Italiane SpA | BNP Paribas | 1.013 | 900 | Ajinomoto Co Inc | HSBC | 3.596 |
| 860 | Poste Italiane SpA | Citibank | (154) | 2.100 | ANA Holdings Inc | Barclays Bank | (974) |
| 1.876 | Poste Italiane SpA | Goldman Sachs | 144 | 1.800 | ANA Holdings Inc | Citibank | (591) |
| 1.709 | Poste Italiane SpA | HSBC | 438 | 1.300 | ANA Holdings Inc | Goldman Sachs | 417 |
| 598 | Prysmian SpA | Citibank | (57) | 400 | Asahi Group Holdings Ltd | BNP Paribas | (360) |
| (627) | Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA | Bank of America Merrill Lynch | 3.140 | 400 | Asahi Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | (360) |
| (355) | Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA | Barclays Bank | 1.077 | 300 | Asahi Group Holdings Ltd | JP Morgan | 368 |
| (299) | Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA | BNP Paribas | 1.497 | (1.700) | Asahi Intecc Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (982) |
| (222) | Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA | Goldman Sachs | 1.112 | (500) | Asahi Intecc Co Ltd | Barclays Bank | 2.401 |
| 13.175 | Snam SpA | Bank of America Merrill Lynch | (2.968) | (1.500) | Asahi Kasei Corp | Goldman Sachs | (289) |
| 26.641 | Snam SpA | Barclays Bank | (4.807) | (3.000) | Asahi Kasei Corp | Merrill Lynch | 140 |
| 14.469 | Snam SpA | BNP Paribas | (3.260) | 2.800 | Astellas Pharma Inc | BNP Paribas | 280 |
| 6.675 | Snam SpA | Citibank | (1.205) | 8.200 | Astellas Pharma Inc | Bank of America Merrill Lynch | 629 |
| 6.700 | Snam SpA | Goldman Sachs | (1.509) | 23.400 | Astellas Pharma Inc | Barclays Bank | (5.938) |
| 23.185 | Snam SpA | HSBC | (4.184) | 2.500 | Astellas Pharma Inc | BNP Paribas | 5.259 |
| 8.582 | Snam SpA | JP Morgan | (1.549) | 7.300 | Astellas Pharma Inc | Citibank | (1.810) |
| 911 | Stellantis NV | Bank of America Merrill Lynch | (533) | 5.000 | Astellas Pharma Inc | Goldman Sachs | 1.641 |
| 727 | Stellantis NV | Barclays Bank | (782) | 2.200 | Astellas Pharma Inc | HSBC | 4.941 |
| 14.171 | Stellantis NV | BNP Paribas | (8.292) | (800) | Azbil Corp | JP Morgan | 2.174 |
| 2.637 | Stellantis NV | Goldman Sachs | (1.543) | (500) | Azbil Corp | BNP Paribas | (57) |
| 1.082 | Stellantis NV | HSBC | (585) | (800) | Azbil Corp | Citibank | 214 |
| 884 | Stellantis NV | JP Morgan | (478) | (800) | Azbil Corp | Goldman Sachs | (57) |
| (7.228) | Tenaris SA | BNP Paribas | 3.666 | (400) | Azbil Corp | HSBC | (1.712) |
| (706) | Tenaris SA | Citibank | 290 | (500) | Bandai Namco Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (36) |
| | | | | (600) | Bandai Namco Holdings Inc | Merrill Lynch | 552 |
| | | | | (3.300) | Bandai Namco Holdings Inc | Barclays Bank | (235) |
| | | | | (1.500) | Bandai Namco Holdings Inc | BNP Paribas | (235) |
| | | | | (4.200) | Bandai Namco Holdings Inc | Citibank | 1.381 |
| | | | | (1.400) | Bandai Namco Holdings Inc | Goldman Sachs | (300) |
| | | | | 600 | Bridgestone Corp | HSBC | (1.698) |
| | | | | 5.300 | Bridgestone Corp | Bank of America Merrill Lynch | 184 |
| | | | | 5.400 | Bridgestone Corp | Barclays Bank | (1.850) |
| | | | | 300 | Bridgestone Corp | BNP Paribas | 1.657 |
| | | | | 1.000 | Bridgestone Corp | Citibank | (232) |
| | | | | 400 | Bridgestone Corp | Goldman Sachs | 307 |
| | | | | 600 | Bridgestone Corp | HSBC | 488 |
| | | | | (700) | Brother Industries Ltd | JP Morgan | 732 |
| | | | | (1.000) | Canon Inc | Barclays Bank | 465 |
| | | | | | | Bank of America Merrill Lynch | (1.541) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-----------------|---|--------------------------|-----------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (2.400) | Canon Inc | Barclays Bank | (342) | 1.100 | Dentsu Group Inc | Goldman Sachs | (3.767) |
| (5.000) | Canon Inc | BNP Paribas | (7.705) | 300 | Dentsu Group Inc | HSBC | (771) |
| (600) | Canon Inc | Citibank | (86) | 300 | Dentsu Group Inc | JP Morgan | (771) |
| (500) | Canon Inc | HSBC | (760) | (300) | Disco Corp | Bank of America | |
| (400) | Capcom Co Ltd | Barclays Bank | 88 | | | Merrill Lynch | (6.592) |
| 1.800 | Central Japan Railway Co | Barclays Bank | (2.575) | (600) | Disco Corp | BNP Paribas | (13.184) |
| 400 | Central Japan Railway Co | BNP Paribas | (271) | (2.800) | East Japan Railway Co | Goldman Sachs | 8.310 |
| 600 | Central Japan Railway Co | Citibank | (828) | (700) | Eisai Co Ltd | Barclays Bank | (2.113) |
| 500 | Central Japan Railway Co | JP Morgan | 801 | (1.100) | Eisai Co Ltd | BNP Paribas | (5.289) |
| (16.500) | Chiba Bank Ltd | Goldman Sachs | 3.649 | (200) | Eisai Co Ltd | Citibank | (604) |
| 7.900 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Barclays Bank | 3.044 | (300) | Eisai Co Ltd | Goldman Sachs | (1.443) |
| 1.700 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | | | (200) | Eisai Co Ltd | HSBC | (1.016) |
| 400 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | BNP Paribas | 1.722 | 14.700 | ENEOS Holdings Inc | Barclays Bank | (1.038) |
| (2.600) | Concordia Financial Group Ltd | Goldman Sachs | 405 | (500) | FANUC Corp | Barclays Bank | (78) |
| (3.600) | Concordia Financial Group Ltd | Barclays Bank | (56) | (2.100) | FANUC Corp | BNP Paribas | (3.146) |
| (3.300) | CyberAgent Inc | Goldman Sachs | | (2.200) | FANUC Corp | Goldman Sachs | (3.296) |
| (4.100) | CyberAgent Inc | Barclays Bank | (56) | (3.300) | FANUC Corp | HSBC | (5.062) |
| (9.900) | CyberAgent Inc | BNP Paribas | (411) | (700) | FANUC Corp | JP Morgan | (1.074) |
| (3.600) | CyberAgent Inc | Bank of America | | (100) | Fast Retailing Co Ltd | BNP Paribas | (521) |
| (5.600) | CyberAgent Inc | Merrill Lynch | 4.050 | (100) | Fast Retailing Co Ltd | Citibank | 992 |
| (4.000) | CyberAgent Inc | Barclays Bank | 3.422 | 1.000 | Fuji Electric Co Ltd | Bank of America | |
| (1.300) | Dai Nippon Printing Co Ltd | BNP Paribas | 12.149 | 7.500 | Fuji Electric Co Ltd | Merrill Lynch | 785 |
| (800) | Dai Nippon Printing Co Ltd | Citibank | 3.005 | 300 | Fuji Electric Co Ltd | Barclays Bank | (16.052) |
| (1.800) | Dai Nippon Printing Co Ltd | Goldman Sachs | 6.872 | 300 | Fuji Electric Co Ltd | Goldman Sachs | 235 |
| (1.800) | Dai Nippon Printing Co Ltd | JP Morgan | 4.167 | 700 | FUJIFILM Holdings Corp | HSBC | 920 |
| (400) | Dai Nippon Printing Co Ltd | Barclays Bank | 927 | 1.900 | FUJIFILM Holdings Corp | Bank of America | |
| (900) | Daiichi Sankyo Co Ltd | BNP Paribas | (342) | 2.600 | FUJIFILM Holdings Corp | Merrill Lynch | 3.766 |
| (1.100) | Daiichi Sankyo Co Ltd | Citibank | 1.284 | 1.900 | FUJIFILM Holdings Corp | Barclays Bank | 3.240 |
| (800) | Daiichi Sankyo Co Ltd | Goldman Sachs | (771) | 1.900 | FUJIFILM Holdings Corp | BNP Paribas | 13.986 |
| (400) | Daikin Industries Ltd | JP Morgan | (200) | 700 | FUJIFILM Holdings Corp | Goldman Sachs | 10.221 |
| (300) | Daikin Industries Ltd | Barclays Bank | 2.151 | (200) | Fujitsu Ltd | JP Morgan | 6.657 |
| (100) | Daikin Industries Ltd | BNP Paribas | 1.067 | (1.600) | GMO Payment Gateway Inc | BNP Paribas | 721 |
| (400) | Daikin Industries Ltd | Goldman Sachs | 776 | | | Bank of America | |
| (300) | Daikin Industries Ltd | Barclays Bank | 3.221 | (100) | GMO Payment Gateway Inc | Merrill Lynch | 3.310 |
| (100) | Daikin Industries Ltd | BNP Paribas | (589) | 6.900 | Hakuhodo DY Holdings Inc | Barclays Bank | 207 |
| (400) | Daikin Industries Ltd | Citibank | 942 | 2.400 | Hakuhodo DY Holdings Inc | Barclays Bank | (5.218) |
| (200) | Daito Trust Construction Co Ltd | Goldman Sachs | (785) | 1.000 | Hakuhodo DY Holdings Inc | Citibank | (1.815) |
| (100) | Daito Trust Construction Co Ltd | Bank of America | | 1.300 | Hamamatsu Photonics KK | Goldman Sachs | (706) |
| (200) | Daito Trust Construction Co Ltd | Merrill Lynch | 214 | | | Bank of America | |
| (100) | Daito Trust Construction Co Ltd | Barclays Bank | 350 | 300 | Hamamatsu Photonics KK | Merrill Lynch | (371) |
| (200) | Daito Trust Construction Co Ltd | BNP Paribas | 214 | 1.400 | Hamamatsu Photonics KK | Barclays Bank | (428) |
| (600) | Daito Trust Construction Co Ltd | Goldman Sachs | 642 | 700 | Hamamatsu Photonics KK | BNP Paribas | (400) |
| (200) | Daito Trust Construction Co Ltd | HSBC | (385) | 800 | Hamamatsu Photonics KK | Goldman Sachs | (200) |
| (100) | Daito Trust Construction Co Ltd | JP Morgan | (193) | 600 | Hamamatsu Photonics KK | HSBC | (1.655) |
| 2.700 | Daiwa House Industry Co Ltd | Barclays Bank | 3.159 | 800 | Hamamatsu Photonics KK | JP Morgan | (1.241) |
| 8.200 | Daiwa House Industry Co Ltd | BNP Paribas | 4.997 | | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Barclays Bank | (828) |
| 6.800 | Daiwa House Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 616 | 2.100 | Hankyu Hanshin Holdings Inc | BNP Paribas | (225) |
| 1.600 | Daiwa House Industry Co Ltd | Citibank | | 600 | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Goldman Sachs | (64) |
| 2.700 | Daiwa House Industry Co Ltd | BNP Paribas | (35) | (100) | Hikari Tsushin Inc | Bank of America | |
| 4.900 | Daiwa Securities Group Inc | Bank of America | 1.984 | (500) | Hikari Tsushin Inc | Merrill Lynch | (899) |
| (300) | Denso Corp | Merrill Lynch | 1.984 | (100) | Hikari Tsushin Inc | Barclays Bank | 428 |
| (800) | Denso Corp | Barclays Bank | (745) | (100) | Hikari Tsushin Inc | BNP Paribas | (899) |
| (400) | Denso Corp | BNP Paribas | 257 | (100) | Hirose Electric Co Ltd | BNP Paribas | (228) |
| (700) | Denso Corp | Goldman Sachs | (1.738) | 1.300 | Hitachi Ltd | Bank of America | |
| 400 | Dentsu Group Inc | Bank of America | | 2.900 | Hitachi Ltd | Merrill Lynch | 705 |
| | | Merrill Lynch | (1.370) | 1.400 | Hitachi Ltd | Barclays Bank | (3.950) |
| 3.800 | Dentsu Group Inc | BNP Paribas | (13.013) | 1.300 | Hitachi Ltd | BNP Paribas | 759 |
| | | | | 1.200 | Hitachi Ltd | Citibank | (851) |
| | | | | 1.200 | Hitachi Ltd | Goldman Sachs | 651 |
| | | | | 700 | Hitachi Ltd | HSBC | 1.169 |
| | | | | 200 | Hitachi Ltd | JP Morgan | 334 |
| | | | | 1.700 | Honda Motor Co Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 3.105 |
| | | | | 1.600 | Honda Motor Co Ltd | Barclays Bank | 491 |
| | | | | 1.800 | Honda Motor Co Ltd | Citibank | (46) |
| | | | | 4.100 | Honda Motor Co Ltd | Goldman Sachs | 7.488 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------|-----------------|---|--------------------------|---------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1.400 | Hoya Corp | Bank of America | | 3.100 | Japan Post Insurance | | |
| | | Merrill Lynch | 21.625 | | Co Ltd | BNP Paribas | (4.269) |
| 100 | Hoya Corp | Barclays Bank | 938 | 1.000 | Japan Post Insurance | | |
| 200 | Hoya Corp | BNP Paribas | 3.089 | | Co Ltd | Citibank | (849) |
| 100 | Hoya Corp | Goldman Sachs | 1.545 | 1.200 | Japan Post Insurance | | |
| 100 | Hoya Corp | HSBC | 1.784 | | Co Ltd | HSBC | (865) |
| 5.600 | Hulic Co Ltd | Barclays Bank | (1.623) | (400) | JFE Holdings Inc | Bank of America | |
| 7.900 | Hulic Co Ltd | Citibank | (2.365) | | | Merrill Lynch | 174 |
| 1.400 | Hulic Co Ltd | Goldman Sachs | (280) | (1.600) | JFE Holdings Inc | Barclays Bank | 833 |
| (300) | Ibiden Co Ltd | Citibank | (2.440) | (1.300) | JFE Holdings Inc | Citibank | 677 |
| 2.300 | Idemitsu Kosan Co Ltd | BNP Paribas | (1.592) | (3.100) | JFE Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.349 |
| 1.500 | Idemitsu Kosan Co Ltd | Goldman Sachs | (1.038) | (1.000) | JSR Corp | Goldman Sachs | (2.461) |
| 900 | Idemitsu Kosan Co Ltd | JP Morgan | (1.162) | (500) | JSR Corp | HSBC | (1.052) |
| (2.900) | Iida Group Holdings Co Ltd | Bank of America | | 9.500 | Kajima Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 3.497 | | | Merrill Lynch | 4.677 |
| (2.600) | Iida Group Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 4.415 | 6.900 | Kajima Corp | Barclays Bank | (8.566) |
| (9.400) | Iida Group Holdings Co Ltd | BNP Paribas | 11.334 | 1.000 | Kajima Corp | Citibank | (1.241) |
| (1.400) | Iida Group Holdings Co Ltd | Citibank | 2.377 | 800 | Kajima Corp | Goldman Sachs | 394 |
| (5.100) | Iida Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 6.149 | 900 | Kajima Corp | HSBC | 790 |
| (900) | Iida Group Holdings Co Ltd | HSBC | 552 | 100 | Kao Corp | Bank of America | |
| 1.000 | Inpex Corp | Citibank | (150) | | | Merrill Lynch | (274) |
| 1.000 | Inpex Corp | Goldman Sachs | 114 | 500 | Kao Corp | Citibank | (1.448) |
| 3.600 | Isuzu Motors Ltd | Bank of America | | 900 | Kao Corp | HSBC | (3.698) |
| | | Merrill Lynch | (693) | 1.000 | KDDI Corp | Bank of America | |
| 2.100 | Isuzu Motors Ltd | Barclays Bank | (1.663) | | | Merrill Lynch | (1.512) |
| 2.600 | Isuzu Motors Ltd | BNP Paribas | (501) | 11.800 | KDDI Corp | Barclays Bank | (16.669) |
| 1.500 | Isuzu Motors Ltd | Citibank | (1.188) | 4.700 | KDDI Corp | BNP Paribas | (7.109) |
| 4.600 | Isuzu Motors Ltd | Goldman Sachs | (886) | 2.400 | KDDI Corp | Citibank | (3.390) |
| 1.000 | Isuzu Motors Ltd | HSBC | 157 | 4.000 | KDDI Corp | Goldman Sachs | (6.050) |
| (400) | ITOCHU Corp | Bank of America | | 1.800 | KDDI Corp | HSBC | 1.015 |
| | | Merrill Lynch | (11) | (1.500) | Keio Corp | BNP Paribas | 2.782 |
| (2.200) | ITOCHU Corp | Barclays Bank | 1.946 | (400) | Keio Corp | Goldman Sachs | 742 |
| (600) | ITOCHU Corp | BNP Paribas | (17) | (400) | Keio Corp | HSBC | 628 |
| (900) | ITOCHU Corp | Goldman Sachs | (26) | (5.500) | Keio Corp | JP Morgan | 8.633 |
| (1.500) | Itochu Techno-Solutions Corp | Bank of America | | (1.600) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.177) | | | Merrill Lynch | (457) |
| (1.500) | Itochu Techno-Solutions Corp | Barclays Bank | (428) | (3.000) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Barclays Bank | 1.712 |
| (2.500) | Itochu Techno-Solutions Corp | BNP Paribas | (1.962) | (1.600) | Keisei Electric Railway Co Ltd | BNP Paribas | (457) |
| (900) | Itochu Techno-Solutions Corp | Citibank | (257) | (600) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Citibank | 342 |
| (1.400) | Itochu Techno-Solutions Corp | Goldman Sachs | (1.099) | (1.200) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Goldman Sachs | (342) |
| (1.600) | Itochu Techno-Solutions Corp | HSBC | (1.541) | (1.300) | Keisei Electric Railway Co Ltd | HSBC | (2.782) |
| (700) | Japan Airlines Co Ltd | Bank of America | | (800) | Keisei Electric Railway Co Ltd | JP Morgan | (1.712) |
| | | Merrill Lynch | 20 | (100) | Keyence Corp | Goldman Sachs | (1.127) |
| (2.100) | Japan Airlines Co Ltd | Barclays Bank | 1.528 | 700 | Kikkoman Corp | Barclays Bank | (849) |
| (3.100) | Japan Airlines Co Ltd | BNP Paribas | 88 | (4.000) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| (7.900) | Japan Airlines Co Ltd | Goldman Sachs | 225 | | | Merrill Lynch | 4.566 |
| (600) | Japan Airlines Co Ltd | HSBC | 111 | (2.500) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 4.370 |
| (600) | Japan Airlines Co Ltd | JP Morgan | 111 | (400) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | BNP Paribas | 457 |
| (4.200) | Japan Exchange Group Inc | Bank of America | | (500) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Citibank | 874 |
| | | Merrill Lynch | (1.363) | (400) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 457 |
| (4.800) | Japan Exchange Group Inc | Barclays Bank | 1.849 | (1.300) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | HSBC | 835 |
| (5.200) | Japan Exchange Group Inc | BNP Paribas | (1.688) | 700 | Kirin Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| (3.700) | Japan Exchange Group Inc | Goldman Sachs | (1.201) | | | Merrill Lynch | (449) |
| (3.500) | Japan Exchange Group Inc | HSBC | (2.160) | 4.600 | Kirin Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (3.430) |
| (15.200) | Japan Post Bank Co Ltd | Bank of America | | 7.500 | Kirin Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (4.816) |
| | | Merrill Lynch | 3.470 | 1.600 | Kirin Holdings Co Ltd | Citibank | (1.193) |
| 12.100 | Japan Post Bank Co Ltd | BNP Paribas | (2.762) | 800 | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | Barclays Bank | (359) |
| (3.000) | Japan Post Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 365 | 300 | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | Citibank | (106) |
| (7.700) | Japan Post Holdings Co Ltd | Citibank | 892 | | | | |
| 800 | Japan Post Insurance Co Ltd | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (1.102) | | | | |
| 1.000 | Japan Post Insurance Co Ltd | Barclays Bank | (849) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 300 | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | (920) | 2.900 | Mazda Motor Corp | Goldman Sachs | (290) |
| (5.500) | Kobe Bussan Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 6.082 | 2.800 | Mazda Motor Corp | HSBC | (859) |
| (300) | Kobe Bussan Co Ltd | Goldman Sachs | 332 | 1.500 | Mazda Motor Corp | JP Morgan | (460) |
| (800) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 731 | (700) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 400 |
| (12.920) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 8.296 | (200) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Barclays Bank | (14) |
| (5.800) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | BNP Paribas | 5.297 | (2.500) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Goldman Sachs | 1.427 |
| (8.200) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 7.488 | (2.100) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | HSBC | 1.199 |
| (3.300) | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | HSBC | 1.789 | 3.800 | MEIJI Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (5.151) |
| (1.800) | Koito Manufacturing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 912 | 2.100 | MEIJI Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (2.847) |
| (4.200) | Koito Manufacturing Co Ltd | Barclays Bank | 3.895 | 1.200 | MEIJI Holdings Co Ltd | Citibank | (1.541) |
| (4.000) | Koito Manufacturing Co Ltd | BNP Paribas | 2.026 | 3.200 | MEIJI Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (4.338) |
| (600) | Koito Manufacturing Co Ltd | Citibank | 556 | 3.200 | MEIJI Holdings Co Ltd | HSBC | (5.251) |
| (1.800) | Koito Manufacturing Co Ltd | Goldman Sachs | 912 | (1.300) | MINEBEA MITSUMI Inc | Barclays Bank | (287) |
| (4.600) | Komatsu Ltd | Barclays Bank | 5.650 | (1.900) | MINEBEA MITSUMI Inc | BNP Paribas | (2.413) |
| (1.800) | Komatsu Ltd | Citibank | 2.447 | (1.200) | MINEBEA MITSUMI Inc | Citibank | (511) |
| (1.100) | Konami Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.648) | (600) | MINEBEA MITSUMI Inc | Goldman Sachs | (762) |
| (800) | Konami Group Corp | Barclays Bank | 1.655 | (600) | MINEBEA MITSUMI Inc | HSBC | (492) |
| (1.100) | Konami Group Corp | BNP Paribas | (1.648) | 500 | MISUMI Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.516) |
| (300) | Konami Group Corp | Citibank | 621 | (5.600) | Mitsubishi Chemical Group Corp | HSBC | (1.052) |
| (1.400) | Konami Group Corp | Goldman Sachs | (2.098) | (13.500) | Mitsubishi Chemical Group Corp | Barclays Bank | 2.880 |
| (300) | Konami Group Corp | HSBC | (1.798) | (2.300) | Mitsubishi Chemical Group Corp | BNP Paribas | 274 |
| (300) | Konami Group Corp | JP Morgan | (1.798) | (1.700) | Mitsubishi Chemical Group Corp | Citibank | 363 |
| (1.200) | Kose Corp | BNP Paribas | 12.328 | (9.600) | Mitsubishi Chemical Group Corp | Goldman Sachs | 1.144 |
| (200) | Kose Corp | Citibank | 2.040 | (4.300) | Mitsubishi Chemical Group Corp | HSBC | 212 |
| (7.700) | Kubota Corp | Barclays Bank | 5.805 | (1.700) | Mitsubishi Chemical Corp | JP Morgan | 84 |
| (10.900) | Kubota Corp | BNP Paribas | 3.499 | 700 | Mitsubishi Corp | Barclays Bank | (205) |
| (1.900) | Kubota Corp | Citibank | 1.223 | 800 | Mitsubishi Corp | BNP Paribas | 1.136 |
| (900) | Kubota Corp | Goldman Sachs | 289 | 1.500 | Mitsubishi Corp | Citibank | (1.774) |
| (100) | Kubota Corp | HSBC | 106 | 25.200 | Mitsubishi Electric Corp | Bank of America Merrill Lynch | 18.159 |
| 300 | Kurita Water Industries Ltd | Citibank | (407) | 5.700 | Mitsubishi Electric Corp | BNP Paribas | 4.107 |
| (400) | Kyocera Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.507) | 9.100 | Mitsubishi Electric Corp | Citibank | 747 |
| (1.400) | Kyocera Corp | BNP Paribas | (5.274) | 1.900 | Mitsubishi Electric Corp | Goldman Sachs | 1.369 |
| (300) | Kyocera Corp | HSBC | (1.599) | 1.200 | Mitsubishi Electric Corp | HSBC | 608 |
| (300) | Kyocera Corp | JP Morgan | (1.599) | 1.900 | Mitsubishi Electric Corp | JP Morgan | 962 |
| (300) | Kyowa Kirin Co Ltd | BNP Paribas | 54 | 4.400 | Mitsubishi Estate Co Ltd | Barclays Bank | (1.253) |
| (1.500) | Kyowa Kirin Co Ltd | Goldman Sachs | 268 | 3.000 | Mitsubishi Estate Co Ltd | BNP Paribas | (856) |
| (700) | Lasertec Corp | Barclays Bank | (1.648) | 2.400 | Mitsubishi Estate Co Ltd | Citibank | (848) |
| (100) | Lasertec Corp | Citibank | (235) | 9.100 | Mitsubishi HC Capital Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.428 |
| (300) | Lasertec Corp | Goldman Sachs | (7.084) | 13.400 | Mitsubishi HC Capital Inc | Barclays Bank | (956) |
| (6.000) | Lixil Corp | Barclays Bank | 6.381 | 21.200 | Mitsubishi HC Capital Inc | BNP Paribas | 3.328 |
| (4.600) | Lixil Corp | BNP Paribas | 6.728 | 31.800 | Mitsubishi HC Capital Inc | Goldman Sachs | 4.991 |
| (4.700) | Lixil Corp | Citibank | 6.472 | 5.200 | Mitsubishi HC Capital Inc | HSBC | 1.892 |
| (3.700) | Lixil Corp | Goldman Sachs | 5.411 | 9.200 | Mitsubishi HC Capital Inc | JP Morgan | 3.347 |
| (600) | M3 Inc | Bank of America Merrill Lynch | (120) | (300) | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Barclays Bank | (411) |
| (3.300) | M3 Inc | BNP Paribas | (659) | 1.600 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | Barclays Bank | 274 |
| (600) | Makita Corp | Bank of America Merrill Lynch | (107) | 2.600 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | BNP Paribas | 883 |
| (3.600) | Makita Corp | Barclays Bank | 6.036 | 1.700 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | Citibank | 24 |
| (1.500) | Makita Corp | BNP Paribas | (268) | 700 | Mitsui & Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 644 |
| (900) | Makita Corp | Citibank | 1.509 | 2.900 | Mitsui & Co Ltd | Barclays Bank | (455) |
| (6.200) | Makita Corp | Goldman Sachs | (1.106) | 2.100 | Mitsui & Co Ltd | BNP Paribas | 1.933 |
| (1.100) | Makita Corp | HSBC | (1.099) | | | | |
| (1.800) | Makita Corp | JP Morgan | (1.798) | | | | |
| 3.600 | Marubeni Corp | Barclays Bank | 26 | | | | |
| 17.000 | Marubeni Corp | BNP Paribas | 4.670 | | | | |
| (300) | MatsukiyoCocokara & Co | HSBC | (471) | | | | |
| 1.600 | Mazda Motor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (160) | | | | |
| 27.900 | Mazda Motor Corp | Barclays Bank | (2.787) | | | | |
| 1.400 | Mazda Motor Corp | Citibank | (140) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1.400 | Mitsui & Co Ltd | Goldman Sachs | 1.288 | 4.200 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | Barclays Bank | (15.582) |
| 100 | Mitsui Chemicals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 11 | 3.900 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | BNP Paribas | (7.234) |
| 1.900 | Mitsui Chemicals Inc | Barclays Bank | (813) | 300 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | Citibank | (1.113) |
| 2.700 | Mitsui Chemicals Inc | BNP Paribas | 289 | 300 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | Goldman Sachs | (556) |
| 4.500 | Mitsui Chemicals Inc | Goldman Sachs | 482 | 700 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | HSBC | (1.648) |
| 2.400 | Mitsui Chemicals Inc | HSBC | 1.284 | 400 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | JP Morgan | (942) |
| (1.700) | Mitsui Fudosan Co Ltd | Barclays Bank | 873 | (13.600) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 17.271 |
| (500) | Mitsui Fudosan Co Ltd | BNP Paribas | 25 | (2.300) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 2.609 |
| (2.300) | Mitsui Fudosan Co Ltd | Goldman Sachs | 115 | (3.600) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 4.572 |
| (400) | Mitsui OSK Lines Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 14 | (400) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | HSBC | 519 |
| (5.900) | Mitsui OSK Lines Ltd | Barclays Bank | (255) | (2.100) | Nippon Sanso Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.019) |
| (1.100) | Mitsui OSK Lines Ltd | BNP Paribas | 39 | (1.100) | Nippon Sanso Holdings Corp | Citibank | 432 |
| (1.800) | Mitsui OSK Lines Ltd | Citibank | 126 | (2.900) | Nippon Sanso Holdings Corp | HSBC | (7.779) |
| (2.600) | Mitsui OSK Lines Ltd | Goldman Sachs | 93 | 1.000 | Nippon Steel Corp | Barclays Bank | (1.067) |
| 700 | Mizuho Financial Group Inc | Citibank | (30) | 8.100 | Nippon Steel Corp | BNP Paribas | (8.293) |
| (3.400) | MonotaRO Co Ltd | Barclays Bank | 1.552 | (2.900) | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Barclays Bank | 4.552 |
| (600) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (741) | (4.700) | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Citibank | 6.026 |
| (2.100) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Barclays Bank | (60) | (2.400) | Nippon Yusen KK | Barclays Bank | 718 |
| (1.500) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | BNP Paribas | (1.851) | (1.500) | Nippon Yusen KK | BNP Paribas | 1.493 |
| (1.300) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Citibank | (37) | (900) | Nippon Yusen KK | Citibank | 382 |
| (800) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Goldman Sachs | (987) | (2.500) | Nippon Yusen KK | Goldman Sachs | 2.488 |
| (500) | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | JP Morgan | (1.138) | 1.700 | Nissan Chemical Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.819) |
| (4.300) | Murata Manufacturing Co Ltd | Barclays Bank | (1.536) | 2.100 | Nissan Chemical Corp | Barclays Bank | (2.397) |
| (1.300) | Murata Manufacturing Co Ltd | Citibank | (677) | 2.900 | Nissan Chemical Corp | Goldman Sachs | (3.103) |
| (2.700) | Murata Manufacturing Co Ltd | Goldman Sachs | (5.586) | 300 | Nissan Chemical Corp | HSBC | 171 |
| 300 | NEC Corp | Bank of America Merrill Lynch | 771 | 900 | Nissan Chemical Corp | JP Morgan | 514 |
| 300 | NEC Corp | Citibank | 449 | (29.000) | Nissan Motor Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.090) |
| 1.600 | NEC Corp | Goldman Sachs | 4.109 | (13.000) | Nissan Motor Co Ltd | Barclays Bank | (56) |
| 1.400 | NEC Corp | HSBC | 5.993 | (3.700) | Nissan Motor Co Ltd | Goldman Sachs | (267) |
| 400 | NEC Corp | JP Morgan | 1.712 | (10.700) | Nissan Motor Co Ltd | HSBC | (1.672) |
| (500) | Nexon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 585 | 1.000 | Nisshin Seifun Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (114) |
| (7.500) | Nexon Co Ltd | Barclays Bank | 9.846 | 1.800 | Nisshin Seifun Group Inc | Barclays Bank | (689) |
| (800) | Nexon Co Ltd | BNP Paribas | 936 | 6.300 | Nisshin Seifun Group Inc | Citibank | (2.651) |
| (400) | Nexon Co Ltd | HSBC | 482 | 2.400 | Nisshin Seifun Group Inc | Goldman Sachs | (274) |
| 2.900 | NGK Insulators Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (972) | 1.100 | Nisshin Seifun Group Inc | HSBC | 698 |
| 4.800 | NGK Insulators Ltd | Barclays Bank | (2.637) | 900 | Nisshin Seifun Group Inc | JP Morgan | 571 |
| 22.500 | NGK Insulators Ltd | Goldman Sachs | (7.545) | 700 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (2.497) |
| 6.600 | NGK Insulators Ltd | HSBC | (2.872) | 3.800 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (14.098) |
| 800 | NGK Insulators Ltd | JP Morgan | (348) | 400 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | HSBC | (3.567) |
| (900) | NIDEC Corp | Bank of America Merrill Lynch | 83 | (100) | Nitori Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.345 |
| (1.100) | NIDEC Corp | Barclays Bank | 3.798 | (200) | Nitori Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 2.048 |
| (400) | NIDEC Corp | Goldman Sachs | 37 | (200) | Nitori Holdings Co Ltd | BNP Paribas | 2.690 |
| (700) | NIDEC Corp | HSBC | (859) | (300) | Nitori Holdings Co Ltd | Citibank | 3.071 |
| (800) | NIDEC Corp | JP Morgan | (982) | (600) | Nitori Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 8.069 |
| (1.400) | Nihon M&A Center Holdings Inc | Barclays Bank | 220 | (200) | Nitori Holdings Co Ltd | HSBC | 392 |
| (2.400) | Nintendo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.329) | (100) | Nitori Holdings Co Ltd | JP Morgan | 196 |
| (1.200) | Nintendo Co Ltd | Barclays Bank | 756 | 800 | Nitto Denko Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.082 |
| (4.800) | Nintendo Co Ltd | BNP Paribas | (4.657) | | | | |
| (300) | Nintendo Co Ltd | Citibank | 265 | | | | |
| (4.000) | Nintendo Co Ltd | Goldman Sachs | (3.881) | | | | |
| 800 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.484) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-----------------|---|--------------------------|---|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 900 | Nitto Denko Corp | Barclays Bank | (1.092) | (2.500) | Open House Group Co Ltd | BNP Paribas | 6.421 |
| 800 | Nitto Denko Corp | Citibank | (970) | (1.500) | Oriental Land Co Ltd | Bank of America | |
| 2.500 | Nitto Denko Corp | Goldman Sachs | 9.632 | | | Merrill Lynch | (1.092) |
| 200 | Nitto Denko Corp | HSBC | 1.612 | (400) | Oriental Land Co Ltd | Barclays Bank | 713 |
| 7.600 | Nitto Denko Corp | JP Morgan | 61.271 | (300) | Oriental Land Co Ltd | Goldman Sachs | (218) |
| (26.500) | Nomura Holdings Inc | Barclays Bank | 2.080 | (900) | Oriental Land Co Ltd | JP Morgan | (2.138) |
| (19.400) | Nomura Holdings Inc | BNP Paribas | 1.107 | 400 | ORIX Corp | Bank of America | |
| (24.200) | Nomura Holdings Inc | Citibank | 2.581 | | | Merrill Lynch | (11) |
| (5.600) | Nomura Holdings Inc | Goldman Sachs | 320 | 9.100 | ORIX Corp | Barclays Bank | (454) |
| (2.800) | Nomura Holdings Inc | HSBC | (226) | 4.400 | ORIX Corp | BNP Paribas | (126) |
| 100 | Nomura Real Estate Holdings Inc | Bank of America | | 6.300 | ORIX Corp | Citibank | (212) |
| | | Merrill Lynch | (11) | 1.100 | ORIX Corp | Goldman Sachs | (31) |
| 3.600 | Nomura Real Estate Holdings Inc | | | 1.600 | ORIX Corp | HSBC | 1.022 |
| | | Barclays Bank | (1.669) | 1.400 | ORIX Corp | JP Morgan | 894 |
| 6.000 | Nomura Real Estate Holdings Inc | BNP Paribas | (642) | 17.000 | Osaka Gas Co Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (10.552) |
| 1.000 | Nomura Real Estate Holdings Inc | Goldman Sachs | (107) | 2.600 | Osaka Gas Co Ltd | Barclays Bank | (1.410) |
| | | | | 1.000 | Osaka Gas Co Ltd | HSBC | (285) |
| 100 | Nomura Real Estate Holdings Inc | HSBC | 36 | 500 | Otsuka Corp | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 178 |
| 200 | Nomura Real Estate Holdings Inc | JP Morgan | 71 | 400 | Otsuka Corp | Barclays Bank | (200) |
| | | Bank of America | | 700 | Otsuka Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 425 |
| (2.100) | Nomura Research Institute Ltd | Merrill Lynch | 375 | (700) | Pan Pacific International Holdings Corp | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 1.149 |
| (1.800) | Nomura Research Institute Ltd | Barclays Bank | 1.926 | (2.500) | Pan Pacific International Holdings Corp | Barclays Bank | 5.172 |
| | | | | (5.100) | Pan Pacific International Holdings Corp | BNP Paribas | 8.369 |
| (600) | Nomura Research Institute Ltd | BNP Paribas | 107 | (2.200) | Pan Pacific International Holdings Corp | Goldman Sachs | 3.610 |
| | | | | (1.600) | Panasonic Holdings Corp | Bank of America | |
| (2.400) | Nomura Research Institute Ltd | Citibank | 2.568 | | | Merrill Lynch | (890) |
| | | | | (3.700) | Panasonic Holdings Corp | Barclays Bank | 370 |
| (2.400) | Nomura Research Institute Ltd | Goldman Sachs | 428 | (2.500) | Panasonic Holdings Corp | BNP Paribas | (1.391) |
| | | | | (1.200) | Panasonic Holdings Corp | HSBC | (1.297) |
| (1.000) | Nomura Research Institute Ltd | HSBC | (392) | 1.500 | Persol Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.526) |
| (1.700) | NTT Data Corp | Merrill Lynch | (934) | | | BNP Paribas | (1.347) |
| | | Barclays Bank | (1.678) | 800 | Persol Holdings Co Ltd | Citibank | (3.451) |
| (16.800) | NTT Data Corp | BNP Paribas | (1.318) | 2.000 | Persol Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (1.010) |
| | | | | 600 | Persol Holdings Co Ltd | JP Morgan | (594) |
| (2.400) | NTT Data Corp | Citibank | (110) | (10.100) | Rakuten Group Inc | Bank of America | |
| (1.100) | NTT Data Corp | Goldman Sachs | (3.406) | | | Merrill Lynch | 4.828 |
| (6.200) | NTT Data Corp | HSBC | (5.201) | (37.800) | Rakuten Group Inc | Barclays Bank | 9.978 |
| (5.400) | NTT Data Corp | BNP Paribas | (218) | (24.200) | Rakuten Group Inc | BNP Paribas | 11.568 |
| 6.100 | Obayashi Corp | Bank of America | | (3.000) | Rakuten Group Inc | Citibank | 792 |
| | | Merrill Lynch | 14 | (60.700) | Rakuten Group Inc | Goldman Sachs | 29.015 |
| 100 | Obic Co Ltd | Barclays Bank | (856) | (10.500) | Rakuten Group Inc | HSBC | 6.817 |
| | | | | 100 | Recruit Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (88) |
| 200 | Obic Co Ltd | BNP Paribas | 29 | 600 | Recruit Holdings Co Ltd | BNP Paribas | 1.772 |
| 100 | Obic Co Ltd | Citibank | (428) | 200 | Recruit Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 591 |
| 100 | Obic Co Ltd | Goldman Sachs | 14 | (7.500) | Renesas Electronics Corp | Bank of America | |
| 100 | Obic Co Ltd | JP Morgan | 778 | | | Merrill Lynch | (18.541) |
| (15.700) | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Barclays Bank | 15.794 | (6.300) | Renesas Electronics Corp | Barclays Bank | (9.304) |
| | | | | (4.800) | Renesas Electronics Corp | BNP Paribas | (11.866) |
| (3.100) | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Goldman Sachs | 1.526 | (3.300) | Renesas Electronics Corp | Goldman Sachs | (8.158) |
| | | | | (800) | Renesas Electronics Corp | HSBC | (2.546) |
| 3.400 | Oji Holdings Corp | BNP Paribas | (24) | (6.600) | Resona Holdings Inc | Barclays Bank | 692 |
| 6.100 | Oji Holdings Corp | Citibank | (305) | 5.000 | Ricoh Co Ltd | Bank of America | |
| 4.200 | Oji Holdings Corp | HSBC | (60) | | | Merrill Lynch | 4.067 |
| (700) | Olympus Corp | Barclays Bank | 914 | 1.500 | Ricoh Co Ltd | Barclays Bank | — |
| (1.400) | Olympus Corp | BNP Paribas | 1.553 | 6.100 | Ricoh Co Ltd | BNP Paribas | 4.961 |
| | | | | 3.000 | Ricoh Co Ltd | JP Morgan | 728 |
| (700) | Olympus Corp | Citibank | 243 | (100) | Rohm Co Ltd | Barclays Bank | (30) |
| (800) | Olympus Corp | JP Morgan | 1.761 | (800) | SBI Holdings Inc | Bank of America | |
| 400 | Omron Corp | Barclays Bank | (263) | | | Merrill Lynch | 594 |
| 100 | Omron Corp | HSBC | 184 | (1.800) | SBI Holdings Inc | BNP Paribas | 1.336 |
| 1.600 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America | | (5.000) | SBI Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.710 |
| | | Merrill Lynch | 394 | (6.900) | SBI Holdings Inc | HSBC | 1.920 |
| 6.700 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Barclays Bank | (1.649) | | | | |
| 3.200 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | BNP Paribas | 788 | | | | |
| 2.100 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 517 | | | | |
| 800 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | HSBC | (702) | | | | |
| 600 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | (527) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------|-----------------|---|--------------------------|----------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.300) | SBI Holdings Inc | JP Morgan | 362 | 2.500 | SoftBank Corp | Goldman Sachs | (776) |
| (8.000) | SCSK Corp | Barclays Bank | 3.139 | 5.300 | SoftBank Corp | JP Morgan | (2.136) |
| (900) | SCSK Corp | BNP Paribas | (199) | (400) | SoftBank Group Corp | Bank of America | |
| (900) | SCSK Corp | Citibank | 353 | | | Merrill Lynch | (1.498) |
| (2.000) | SCSK Corp | Goldman Sachs | (442) | (800) | SoftBank Group Corp | Barclays Bank | (1.467) |
| (3.400) | SCSK Corp | HSBC | (2.547) | (800) | SoftBank Group Corp | BNP Paribas | (2.996) |
| 1.400 | Secom Co Ltd | Bank of America | | (600) | SoftBank Group Corp | Citibank | (1.100) |
| | | Merrill Lynch | (979) | (2.000) | SoftBank Group Corp | Goldman Sachs | (7.491) |
| 900 | Secom Co Ltd | BNP Paribas | (629) | (3.600) | SoftBank Group Corp | HSBC | (9.118) |
| 300 | Secom Co Ltd | Citibank | (659) | (900) | Sompo Holdings Inc | Bank of America | |
| 600 | Secom Co Ltd | Goldman Sachs | (420) | | | Merrill Lynch | 1.015 |
| 400 | Secom Co Ltd | HSBC | 1.116 | (600) | Sompo Holdings Inc | Barclays Bank | 1.387 |
| 300 | Secom Co Ltd | JP Morgan | 837 | (2.400) | Sompo Holdings Inc | BNP Paribas | 2.705 |
| 800 | Seiko Epson Corp | Bank of America | | (600) | Sompo Holdings Inc | Citibank | 1.387 |
| | | Merrill Lynch | 285 | (1.800) | Sompo Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.029 |
| 2.700 | Seiko Epson Corp | Barclays Bank | (674) | (600) | Sompo Holdings Inc | HSBC | (43) |
| 1.100 | Seiko Epson Corp | BNP Paribas | 392 | (300) | Sompo Holdings Inc | JP Morgan | (21) |
| 700 | Seiko Epson Corp | Goldman Sachs | 250 | (200) | Sony Group Corp | Barclays Bank | 642 |
| 1.500 | Sekisui Chemical Co Ltd | Bank of America | | (900) | Sony Group Corp | BNP Paribas | (1.830) |
| | | Merrill Lynch | 11 | (600) | Sony Group Corp | Citibank | 1.926 |
| 2.500 | Sekisui Chemical Co Ltd | Barclays Bank | (1.516) | (100) | Sony Group Corp | Goldman Sachs | (203) |
| 39.600 | Sekisui Chemical Co Ltd | BNP Paribas | 283 | (300) | Square Enix Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| 3.300 | Sekisui Chemical Co Ltd | Citibank | (2.001) | | | Merrill Lynch | 1.092 |
| 4.100 | Sekisui Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | 29 | (2.300) | Square Enix Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 8.533 |
| 700 | Sekisui Chemical Co Ltd | HSBC | 270 | | | BNP Paribas | 6.549 |
| 800 | Sekisui Chemical Co Ltd | JP Morgan | 308 | (1.800) | Square Enix Holdings Co Ltd | Citibank | 2.226 |
| 4.700 | Sekisui House Ltd | BNP Paribas | (4.259) | (600) | Square Enix Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 3.639 |
| 1.200 | SG Holdings Co Ltd | Barclays Bank | (1.147) | (1.000) | Square Enix Holdings Co Ltd | HSBC | 3.710 |
| 400 | SG Holdings Co Ltd | HSBC | (77) | (300) | Square Enix Holdings Co Ltd | JP Morgan | 856 |
| (17.600) | Sharp Corp | Bank of America | | | | Barclays Bank | 908 |
| | | Merrill Lynch | 9.543 | 2.400 | Subaru Corp | BNP Paribas | 3.527 |
| (35.900) | Sharp Corp | Barclays Bank | 16.392 | 3.200 | Subaru Corp | Goldman Sachs | 3.858 |
| (17.100) | Sharp Corp | Goldman Sachs | 9.272 | 3.500 | Subaru Corp | HSBC | 3.845 |
| (5.900) | Sharp Corp | HSBC | 7.745 | 2.800 | Subaru Corp | JP Morgan | 1.099 |
| (800) | Sharp Corp | JP Morgan | 1.050 | 800 | Subaru Corp | Bank of America | |
| 400 | Shimadzu Corp | Barclays Bank | (428) | (1.800) | SUMCO Corp | Merrill Lynch | (1.811) |
| 1.300 | Shimadzu Corp | Goldman Sachs | (185) | (600) | SUMCO Corp | Barclays Bank | (197) |
| (100) | Shimano Inc | Bank of America | | (1.900) | SUMCO Corp | Citibank | (624) |
| | | Merrill Lynch | (243) | (2.400) | SUMCO Corp | Goldman Sachs | (2.414) |
| (500) | Shimano Inc | Barclays Bank | 375 | (4.900) | SUMCO Corp | HSBC | (2.937) |
| (100) | Shimano Inc | BNP Paribas | (243) | (3.000) | Sumitomo Chemical Co Ltd | Bank of America | |
| (300) | Shimano Inc | Citibank | 225 | | | Merrill Lynch | 749 |
| (400) | Shimano Inc | Goldman Sachs | (970) | (4.800) | Sumitomo Chemical Co Ltd | Barclays Bank | 411 |
| (19.600) | Shimizu Corp | BNP Paribas | 1.678 | (8.800) | Sumitomo Chemical Co Ltd | BNP Paribas | 2.197 |
| 1.700 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | BNP Paribas | 4.087 | (7.800) | Sumitomo Chemical Co Ltd | Citibank | 668 |
| 700 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | 1.683 | (3.000) | Sumitomo Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | 749 |
| 3.100 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | HSBC | 7.055 | (11.600) | Sumitomo Chemical Co Ltd | HSBC | 2.979 |
| 1.500 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | JP Morgan | 3.414 | (3.600) | Sumitomo Chemical Co Ltd | JP Morgan | 925 |
| 800 | Shionogi & Co Ltd | Bank of America | | 1.500 | Sumitomo Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 320 | | | Merrill Lynch | 476 |
| 2.200 | Shionogi & Co Ltd | Barclays Bank | (1.193) | 2.400 | Sumitomo Corp | Barclays Bank | (642) |
| 3.100 | Shionogi & Co Ltd | BNP Paribas | 1.239 | 6.200 | Sumitomo Corp | BNP Paribas | 1.968 |
| 800 | Shionogi & Co Ltd | Citibank | (434) | 600 | Sumitomo Corp | Citibank | (161) |
| 2.600 | Shionogi & Co Ltd | Goldman Sachs | 1.039 | 2.100 | Sumitomo Corp | Goldman Sachs | 667 |
| 1.100 | Shionogi & Co Ltd | HSBC | 589 | 2.600 | Sumitomo Corp | HSBC | 2.903 |
| 300 | Shionogi & Co Ltd | JP Morgan | 161 | 700 | Sumitomo Corp | JP Morgan | 782 |
| 300 | Shiseido Co Ltd | Barclays Bank | (1.256) | (4.800) | Sumitomo Electric Industries Ltd | Barclays Bank | 2.329 |
| 300 | Shiseido Co Ltd | BNP Paribas | (1.190) | (26.900) | Sumitomo Electric Industries Ltd | BNP Paribas | 7.101 |
| 500 | Shiseido Co Ltd | Goldman Sachs | (1.983) | (3.300) | Sumitomo Electric Industries Ltd | Goldman Sachs | 871 |
| 300 | Shiseido Co Ltd | HSBC | (458) | | | | |
| (3.400) | Shizuoka Financial Group Inc | BNP Paribas | 485 | | | | |
| 100 | SMC Corp | Barclays Bank | 114 | | | | |
| 200 | SMC Corp | BNP Paribas | 5.180 | | | | |
| 9.500 | SoftBank Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (2.948) | | | | |
| 5.700 | SoftBank Corp | Barclays Bank | (1.220) | | | | |
| 3.900 | SoftBank Corp | BNP Paribas | (1.210) | | | | |
| 2.100 | SoftBank Corp | Citibank | (449) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|---------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (500) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 710 | 1.700 | Terumo Corp | BNP Paribas | 49 |
| (9.600) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | Barclays Bank | 10.462 | 100 | Terumo Corp | HSBC | 96 |
| (1.600) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | BNP Paribas | 2.272 | (1.700) | TIS Inc | HSBC | (364) |
| (3.800) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | Citibank | 4.275 | (3.000) | Tobu Railway Co Ltd | Barclays Bank | 2.889 |
| (400) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | Goldman Sachs | 568 | (300) | Toho Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 64 |
| 2.300 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.018) | (5.000) | Toho Co Ltd | HSBC | (2.497) |
| 2.600 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | Barclays Bank | 519 | (700) | Tokio Marine Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.643) |
| 2.300 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | BNP Paribas | (2.018) | (4.300) | Tokio Marine Holdings Inc | Barclays Bank | (3.681) |
| 300 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | Citibank | 60 | (1.400) | Tokio Marine Holdings Inc | BNP Paribas | (3.286) |
| 1.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | Goldman Sachs | (878) | (2.400) | Tokio Marine Holdings Inc | Goldman Sachs | (5.633) |
| 1.200 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.370) | (2.400) | Tokio Marine Holdings Inc | HSBC | (7.269) |
| 300 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Barclays Bank | (591) | (700) | Tokio Marine Holdings Inc | JP Morgan | (2.120) |
| 800 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Citibank | (1.575) | (100) | Tokyo Electron Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.240) |
| 1.000 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.142) | (600) | Tokyo Electron Ltd | Barclays Bank | (2.804) |
| 600 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | JP Morgan | 68 | 12.600 | Tokyo Gas Co Ltd | Barclays Bank | (2.337) |
| 400 | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 365 | 3.900 | Tokyo Gas Co Ltd | BNP Paribas | (56) |
| 300 | Suntory Beverage & Food Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (407) | 2.400 | Tokyo Gas Co Ltd | HSBC | 2.175 |
| 1.500 | Suntory Beverage & Food Ltd | Barclays Bank | (3.960) | (11.500) | Tokyu Corp | Bank of America Merrill Lynch | 14.686 |
| 300 | Suntory Beverage & Food Ltd | Goldman Sachs | (407) | (13.700) | Tokyu Corp | Barclays Bank | 16.225 |
| 400 | Suntory Beverage & Food Ltd | JP Morgan | 285 | (14.300) | Tokyu Corp | BNP Paribas | 18.262 |
| 400 | Suzuki Motor Corp | Barclays Bank | (394) | (1.900) | Tokyu Corp | Citibank | 2.250 |
| 400 | Suzuki Motor Corp | BNP Paribas | (930) | (11.300) | Tokyu Corp | Goldman Sachs | 14.431 |
| 700 | Sysmex Corp | Bank of America Merrill Lynch | (924) | (1.800) | Tokyu Corp | HSBC | 1.888 |
| 300 | Sysmex Corp | BNP Paribas | (396) | (1.300) | Tokyu Corp | JP Morgan | 1.363 |
| 300 | Sysmex Corp | Goldman Sachs | (396) | 7.600 | TOPPAN Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.928 |
| (900) | T&D Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (700) | 3.100 | TOPPAN Inc | Barclays Bank | (597) |
| (4.500) | T&D Holdings Inc | BNP Paribas | (3.499) | 1.300 | TOPPAN Inc | Goldman Sachs | 501 |
| (1.400) | T&D Holdings Inc | Citibank | 390 | 17.600 | Toray Industries Inc | Goldman Sachs | (2.687) |
| (800) | T&D Holdings Inc | Goldman Sachs | (622) | (900) | Toshiba Corp | Bank of America Merrill Lynch | (398) |
| (1.900) | T&D Holdings Inc | HSBC | (3.009) | (4.700) | Toshiba Corp | Barclays Bank | (351) |
| (2.200) | Taisei Corp | Barclays Bank | 4.241 | (400) | Toshiba Corp | BNP Paribas | (177) |
| (700) | Taisei Corp | BNP Paribas | 1.973 | (4.200) | Toshiba Corp | Citibank | (330) |
| (400) | Taisei Corp | Goldman Sachs | 1.127 | (1.400) | Toshiba Corp | HSBC | (719) |
| (400) | Taisei Corp | HSBC | 785 | (500) | Toshiba Corp | JP Morgan | (257) |
| (400) | Taisei Corp | JP Morgan | 785 | 400 | Tosoh Corp | Bank of America Merrill Lynch | (228) |
| (400) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 197 | 900 | Tosoh Corp | Barclays Bank | (674) |
| (800) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | Barclays Bank | 753 | 4.400 | TOTO Ltd | Barclays Bank | (11.458) |
| (1.600) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | BNP Paribas | 788 | 500 | Toyota Industries Corp | Barclays Bank | 1.106 |
| (1.300) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 640 | 1.100 | Toyota Industries Corp | BNP Paribas | 4.944 |
| (700) | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | JP Morgan | 859 | 900 | Toyota Industries Corp | Goldman Sachs | 4.045 |
| 700 | TDK Corp | Goldman Sachs | 2.322 | (2.200) | Toyota Motor Corp | Bank of America Merrill Lynch | 385 |
| 1.600 | TDK Corp | HSBC | 5.650 | (3.500) | Toyota Motor Corp | Barclays Bank | 1.036 |
| 3.700 | Terumo Corp | Barclays Bank | 185 | (3.200) | Toyota Motor Corp | BNP Paribas | 559 |
| | | | | (800) | Toyota Motor Corp | Citibank | 237 |
| | | | | (8.000) | Toyota Motor Corp | Goldman Sachs | 1.398 |
| | | | | (5.800) | Toyota Motor Corp | HSBC | (2.172) |
| | | | | 800 | Toyota Tsusho Corp | Bank of America Merrill Lynch | 799 |
| | | | | 900 | Toyota Tsusho Corp | Barclays Bank | (916) |
| | | | | 900 | Toyota Tsusho Corp | BNP Paribas | 899 |
| | | | | 600 | Toyota Tsusho Corp | Citibank | (428) |
| | | | | 1.500 | Toyota Tsusho Corp | HSBC | 3.960 |
| | | | | 900 | Trend Micro Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.926 |
| | | | | 300 | Trend Micro Inc | Citibank | 385 |
| | | | | 600 | Trend Micro Inc | Goldman Sachs | 1.284 |
| | | | | 200 | Trend Micro Inc | HSBC | 86 |
| | | | | 300 | Trend Micro Inc | JP Morgan | 128 |
| | | | | 300 | Unicharm Corp | Bank of America Merrill Lynch | (291) |
| | | | | 300 | Unicharm Corp | Barclays Bank | (223) |
| | | | | 2.200 | Unicharm Corp | BNP Paribas | (2.135) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------|-----------------|---|--------------------------------|-------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| 400 | Unicharm Corp | Citibank | (297) | (7) | Adyen NV | Goldman Sachs | (870) |
| 700 | Unicharm Corp | Goldman Sachs | (679) | (33) | Adyen NV | HSBC | (3.883) |
| 600 | Unicharm Corp | HSBC | (886) | (7) | Adyen NV | JP Morgan | (824) |
| 300 | Unicharm Corp | JP Morgan | (443) | (12.507) | Aegon NV | Barclays Bank | 3.138 |
| 8.300 | USS Co Ltd | BNP Paribas | (5.981) | (20.752) | Aegon NV | BNP Paribas | 1.219 |
| (600) | Welcia Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 972 | (3.973) | Aegon NV | Citibank | 997 |
| (1.300) | Welcia Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (9) | (2.421) | Aegon NV | JP Morgan | (119) |
| (300) | Welcia Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (2) | (387) | Akzo Nobel NV | Bank of America | |
| (200) | Welcia Holdings Co Ltd | HSBC | (156) | | Akzo Nobel NV | Merrill Lynch | 2.273 |
| (400) | West Japan Railway Co | Bank of America | | (876) | Akzo Nobel NV | Barclays Bank | 5.294 |
| | | Merrill Lynch | 813 | (2.664) | Akzo Nobel NV | BNP Paribas | 15.645 |
| (1.500) | West Japan Railway Co | HSBC | 2.140 | (469) | Akzo Nobel NV | Citibank | 2.834 |
| 200 | Yakult Honsha Co Ltd | Bank of America | | (963) | Akzo Nobel NV | Goldman Sachs | 5.655 |
| | | Merrill Lynch | (1.256) | (545) | Akzo Nobel NV | HSBC | 2.595 |
| 1.800 | Yakult Honsha Co Ltd | Barclays Bank | (8.861) | (438) | Akzo Nobel NV | JP Morgan | 2.086 |
| 700 | Yakult Honsha Co Ltd | BNP Paribas | (4.395) | 978 | ArcelorMittal SA | Bank of America | |
| 400 | Yakult Honsha Co Ltd | Goldman Sachs | (2.511) | | ArcelorMittal SA | Merrill Lynch | (1.138) |
| 400 | Yakult Honsha Co Ltd | HSBC | (3.425) | 3.767 | ArcelorMittal SA | Barclays Bank | (3.161) |
| 200 | Yakult Honsha Co Ltd | JP Morgan | (1.712) | 2.371 | ArcelorMittal SA | Citibank | (2.682) |
| (300) | Yamaha Corp | Bank of America | | 350 | ArcelorMittal SA | HSBC | (676) |
| | | Merrill Lynch | (300) | (15) | ASM International NV | Barclays Bank | (617) |
| (900) | Yamaha Corp | Barclays Bank | 963 | (198) | ASM International NV | BNP Paribas | (14.260) |
| (400) | Yamaha Corp | BNP Paribas | (400) | 48 | ASML Holding NV | Bank of America | |
| (700) | Yamaha Corp | Citibank | 749 | | ASML Holding NV | Merrill Lynch | 4.167 |
| (2.000) | Yamaha Corp | Goldman Sachs | (1.998) | 161 | ASML Holding NV | Barclays Bank | 4.596 |
| 1.300 | Yamaha Motor Co Ltd | Barclays Bank | (232) | 423 | ASML Holding NV | BNP Paribas | 36.720 |
| 500 | Yamaha Motor Co Ltd | JP Morgan | (63) | 78 | ASML Holding NV | Goldman Sachs | 6.771 |
| (1.700) | Yamato Holdings Co Ltd | Bank of America | | 19 | ASML Holding NV | HSBC | 1.737 |
| | | Merrill Lynch | (825) | 17 | ASML Holding NV | JP Morgan | 1.554 |
| (2.900) | Yamato Holdings Co Ltd | Barclays Bank | 807 | (81) | DSM-Firmenich AG | Bank of America | |
| (4.500) | Yamato Holdings Co Ltd | BNP Paribas | (2.183) | | DSM-Firmenich AG | Merrill Lynch | 1.159 |
| (1.000) | Yamato Holdings Co Ltd | Citibank | 278 | (1.032) | DSM-Firmenich AG | Barclays Bank | 14.832 |
| (2.900) | Yamato Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (1.407) | (367) | DSM-Firmenich AG | BNP Paribas | 5.251 |
| (800) | Yamato Holdings Co Ltd | HSBC | (1.159) | (494) | DSM-Firmenich AG | HSBC | 7.965 |
| (1.000) | Yaskawa Electric Corp | Bank of America | | 612 | EXOR NV | Barclays Bank | (1.804) |
| | | Merrill Lynch | (1.356) | 1.545 | EXOR NV | BNP Paribas | (759) |
| (1.500) | Yaskawa Electric Corp | Barclays Bank | (642) | 133 | Heineken Holding NV | Barclays Bank | (774) |
| (1.600) | Yaskawa Electric Corp | BNP Paribas | (2.169) | (27) | Heineken NV | Bank of America | |
| (1.200) | Yaskawa Electric Corp | Goldman Sachs | (1.627) | | Heineken NV | Merrill Lynch | 306 |
| 6.300 | Yokogawa Electric Corp | Bank of America | | (112) | Heineken NV | Barclays Bank | 911 |
| | | Merrill Lynch | 8.315 | (1.169) | Heineken NV | BNP Paribas | 13.256 |
| (8.100) | Z Holdings Corp | Bank of America | | (35) | Heineken NV | Citibank | 285 |
| | | Merrill Lynch | 693 | (113) | Heineken NV | Goldman Sachs | 1.281 |
| (24.900) | Z Holdings Corp | Barclays Bank | 2.167 | (349) | Heineken NV | HSBC | 4.013 |
| (54.600) | Z Holdings Corp | BNP Paribas | 4.674 | (63) | IMCD NV | Bank of America | |
| (4.300) | Z Holdings Corp | Citibank | 374 | | IMCD NV | Merrill Lynch | (7) |
| (42.200) | Z Holdings Corp | Goldman Sachs | 3.613 | (196) | IMCD NV | Barclays Bank | 235 |
| (49.900) | Z Holdings Corp | HSBC | 3.133 | (584) | IMCD NV | BNP Paribas | (62) |
| 500 | ZOZO Inc | Bank of America | | (472) | IMCD NV | Citibank | 458 |
| | | Merrill Lynch | (842) | 1.121 | ING Groep NV | Bank of America | |
| 4.900 | ZOZO Inc | Barclays Bank | (5.628) | | ING Groep NV | Merrill Lynch | (112) |
| 2.600 | ZOZO Inc | BNP Paribas | (4.378) | 2.183 | ING Groep NV | Barclays Bank | (662) |
| 2.100 | ZOZO Inc | Goldman Sachs | (3.536) | 1.732 | ING Groep NV | BNP Paribas | (174) |
| 1.600 | ZOZO Inc | HSBC | (205) | 834 | ING Groep NV | Goldman Sachs | (84) |
| 1.200 | ZOZO Inc | JP Morgan | (154) | (1.334) | JDE Peet's NV | BNP Paribas | 541 |
| | | | 327.597 | (363) | JDE Peet's NV | Goldman Sachs | 147 |
| | | | | (843) | Just Eat Takeaway.com NV | Barclays Bank | 1.465 |
| | | | | (1.708) | Just Eat Takeaway.com NV | BNP Paribas | 4.636 |
| | | | | (405) | Just Eat Takeaway.com NV | Goldman Sachs | 1.099 |
| | | | | (266) | Just Eat Takeaway.com NV | HSBC | 623 |
| | | | | 373 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | Bank of America | |
| | | | | | Koninklijke Ahold Delhaize NV | Merrill Lynch | (570) |
| | | | | 1.160 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | Barclays Bank | (1.325) |
| | | | | 8.617 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | BNP Paribas | (13.157) |
| | | | | 707 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | Goldman Sachs | (1.079) |
| | | | | 6.068 | Koninklijke KPN NV | Bank of America | |
| | | | | | Koninklijke KPN NV | Merrill Lynch | (577) |
| | | | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|-------------------------------|-----------------|---|-----------------------------|--------------------------------------|-----------------|---|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweden Fortsetzung | | | |
| 557 | Assa Abloy AB 'B' | Bank of America | | 3.035 | Investor AB 'B' | Goldman Sachs | 1.564 |
| | | Merrill Lynch | (195) | 1.831 | Investor AB 'B' | HSBC | 463 |
| 2.106 | Assa Abloy AB 'B' | Barclays Bank | (885) | 6.456 | Investor AB 'B' | JP Morgan | 1.633 |
| 5.063 | Assa Abloy AB 'B' | BNP Paribas | (1.770) | (434) | L E Lundbergforetagen AB 'B' | | |
| 1.567 | Assa Abloy AB 'B' | Citibank | (688) | (1.588) | L E Lundbergforetagen AB 'B' | Barclays Bank | 1.238 |
| 3.111 | Assa Abloy AB 'B' | Goldman Sachs | (1.088) | (1.422) | Lifco AB 'B' | BNP Paribas | 5.157 |
| 903 | Assa Abloy AB 'B' | HSBC | 83 | (2) | NCC AB 'B' | BNP Paribas | 1.060 |
| 1.286 | Assa Abloy AB 'B' | JP Morgan | 118 | (641) | Nibe Industrier AB 'B' | Bank of America | 2 |
| (6.955) | Atlas Copco AB 'A' | BNP Paribas | (5.663) | (951) | Nibe Industrier AB 'B' | Merrill Lynch | 793 |
| 171 | Boliden AB | Barclays Bank | (997) | (3.731) | Nibe Industrier AB 'B' | Goldman Sachs | 4.617 |
| 2.110 | Boliden AB | BNP Paribas | (4.232) | (1.356) | Nibe Industrier AB 'B' | HSBC | 1.279 |
| (3.446) | Electrolux AB 'B' | Barclays Bank | 6.689 | 2.407 | Nordea Bank Abp | Bank of America | |
| (168) | Electrolux AB 'B' | Citibank | 326 | 1.183 | Nordea Bank Abp | Merrill Lynch | (142) |
| (11.789) | Electrolux AB 'B' | Goldman Sachs | 21.258 | 15.251 | Nordea Bank Abp | Barclays Bank | (231) |
| (2.042) | Electrolux AB 'B' | JP Morgan | 4.518 | 3.272 | Nordea Bank Abp | BNP Paribas | (898) |
| (14.398) | Embracer Group AB | Bank of America | | 5.544 | Nordea Bank Abp | Goldman Sachs | (193) |
| | | Merrill Lynch | 37.182 | 2.269 | Sandvik AB | HSBC | (887) |
| (14.495) | Embracer Group AB | Barclays Bank | 11.024 | 655 | Sandvik AB | Barclays Bank | (2.672) |
| (21.652) | Embracer Group AB | Citibank | (3.837) | 1.296 | Sandvik AB | Citibank | (771) |
| (20.440) | Embracer Group AB | Goldman Sachs | 52.785 | (6.786) | Securitas AB 'B' | Goldman Sachs | (1.323) |
| (2.161) | Embracer Group AB | JP Morgan | 5.422 | (79) | Securitas AB 'B' | BNP Paribas | 4.220 |
| 4.065 | Epiroc AB 'A' | Bank of America | | 1.177 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Goldman Sachs | 49 |
| | | Merrill Lynch | (5.404) | 4.493 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Barclays Bank | (184) |
| 4.471 | Epiroc AB 'A' | Barclays Bank | (7.630) | 2.004 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | BNP Paribas | (475) |
| 1.430 | Epiroc AB 'A' | BNP Paribas | (1.901) | 1.944 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | HSBC | (221) |
| 773 | Epiroc AB 'A' | Citibank | (1.319) | 663 | Skanska AB 'B' | JP Morgan | (215) |
| 2.693 | Epiroc AB 'A' | HSBC | (3.977) | 1.695 | Skanska AB 'B' | Barclays Bank | (409) |
| 767 | Epiroc AB 'A' | JP Morgan | (1.133) | 1.603 | Skanska AB 'B' | BNP Paribas | (1.294) |
| (3.341) | EQT AB | BNP Paribas | 1.629 | 2.421 | Skanska AB 'B' | Goldman Sachs | (1.849) |
| (437) | Essity AB 'B' | Barclays Bank | 808 | (510) | SKF AB 'B' | Bank of America | |
| (10) | Essity AB 'B' | Goldman Sachs | 14 | (646) | SKF AB 'B' | Merrill Lynch | 441 |
| 81 | Evolution AB | Bank of America | | (1.753) | SKF AB 'B' | BNP Paribas | 559 |
| | | Merrill Lynch | 516 | (2.488) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | HSBC | 2.064 |
| 194 | Evolution AB | Barclays Bank | (36) | (2.722) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | Bank of America | |
| 202 | Evolution AB | HSBC | 2.698 | (15.635) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | Merrill Lynch | 149 |
| 120 | Evolution AB | JP Morgan | 1.603 | (1.259) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | Barclays Bank | (163) |
| (364) | Fastighets AB Balder 'B' | Bank of America | | (8.796) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | BNP Paribas | 935 |
| | | Merrill Lynch | 138 | (840) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | BNP Paribas | 935 |
| (6.717) | Fastighets AB Balder 'B' | BNP Paribas | 2.552 | 1.208 | Svenska Handelsbanken AB 'A' | Citibank | (75) |
| (2.195) | Fastighets AB Balder 'B' | Goldman Sachs | 834 | 498 | Swedbank AB 'A' | Goldman Sachs | 526 |
| (1.324) | Getinge AB 'B' | Barclays Bank | 365 | 2.294 | Swedbank AB 'A' | HSBC | (4) |
| (396) | Getinge AB 'B' | HSBC | (26) | 669 | Swedbank AB 'A' | HSBC | (137) |
| (1.689) | H & M Hennes & Mauritz AB 'B' | Bank of America | | 1.642 | Swedbank AB 'A' | Bank of America | |
| (5.578) | H & M Hennes & Mauritz AB 'B' | Merrill Lynch | 1.113 | (2.204) | Swedish Orphan Biovitrum AB | Merrill Lynch | 3.731 |
| | | BNP Paribas | 3.674 | (713) | Swedish Orphan Biovitrum AB | Barclays Bank | 155 |
| (5.226) | Hexagon AB 'B' | Barclays Bank | (2.207) | (340) | Swedish Orphan Biovitrum AB | BNP Paribas | 576 |
| (14.898) | Hexagon AB 'B' | BNP Paribas | (13.912) | (1.246) | Swedish Orphan Biovitrum AB | Goldman Sachs | 2.109 |
| (136) | Hexagon AB 'B' | Goldman Sachs | (127) | (8.733) | Tele2 AB 'B' | BNP Paribas | 6.652 |
| (1.132) | Holmen AB 'B' | Barclays Bank | (10) | (2.333) | Tele2 AB 'B' | Citibank | 500 |
| (1.274) | Holmen AB 'B' | BNP Paribas | 375 | | | | |
| (1.364) | Holmen AB 'B' | Goldman Sachs | 402 | | | | |
| (1.240) | Holmen AB 'B' | HSBC | (171) | | | | |
| (4.960) | Husqvarna AB 'B' | Barclays Bank | 4.536 | | | | |
| (8.974) | Husqvarna AB 'B' | BNP Paribas | 9.577 | | | | |
| (9.187) | Husqvarna AB 'B' | Goldman Sachs | 9.804 | | | | |
| 2.160 | Industrivarden AB 'C' | Barclays Bank | (537) | | | | |
| 1.960 | Industrivarden AB 'C' | BNP Paribas | (18) | | | | |
| 2.358 | Industrivarden AB 'C' | Citibank | (586) | | | | |
| 2.574 | Industrivarden AB 'C' | Goldman Sachs | (24) | | | | |
| 4.184 | Industrivarden AB 'C' | HSBC | 192 | | | | |
| 1.508 | Indutrade AB | BNP Paribas | (291) | | | | |
| 464 | Indutrade AB | Citibank | (149) | | | | |
| 1.226 | Indutrade AB | Goldman Sachs | (237) | | | | |
| 932 | Indutrade AB | JP Morgan | (9) | | | | |
| (9.359) | Investment AB Latour 'B' | Goldman Sachs | 4.994 | | | | |
| 3.238 | Investor AB 'B' | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 1.668 | | | | |
| 2.046 | Investor AB 'B' | Barclays Bank | 452 | | | | |
| 4.237 | Investor AB 'B' | BNP Paribas | 2.183 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--|-----------------|---|----------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| (2.069) | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | Barclays Bank | 99 | 1.857 | Clariant AG Reg | Goldman Sachs | (1.791) |
| (1.881) | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | BNP Paribas | (268) | 2.461 | Clariant AG Reg | HSBC | (3.101) |
| (2.393) | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | HSBC | (192) | 1.974 | Clariant AG Reg | JP Morgan | (2.487) |
| (8.842) | Telia Co AB | Bank of America | | (140) | EMS-Chemie Holding AG Reg | Barclays Bank | 690 |
| | | Merrill Lynch | 1.375 | 20 | Geberit AG Reg | Bank of America | |
| (26.746) | Telia Co AB | Barclays Bank | 2.364 | 77 | Geberit AG Reg | Merrill Lynch | (348) |
| (54.814) | Telia Co AB | BNP Paribas | 8.522 | 135 | Geberit AG Reg | Barclays Bank | (772) |
| (12.662) | Telia Co AB | Goldman Sachs | 1.969 | 60 | Geberit AG Reg | BNP Paribas | (2.352) |
| (8.784) | Telia Co AB | JP Morgan | 1.350 | 53 | Geberit AG Reg | Citibank | (655) |
| 637 | Volvo AB 'B' | Bank of America | | 168 | Geberit AG Reg | Goldman Sachs | (923) |
| | | Merrill Lynch | (352) | 42 | Geberit AG Reg | HSBC | (4.731) |
| 1.310 | Volvo AB 'B' | Barclays Bank | (976) | (4) | Givaudan SA Reg | JP Morgan | (1.183) |
| 1.067 | Volvo AB 'B' | BNP Paribas | (589) | (7) | Givaudan SA Reg | Barclays Bank | (53) |
| 3.935 | Volvo AB 'B' | Goldman Sachs | (2.172) | (5) | Givaudan SA Reg | BNP Paribas | 1.012 |
| 525 | Volvo AB 'B' | HSBC | (307) | (5) | Givaudan SA Reg | HSBC | 685 |
| 5.639 | Volvo AB 'B' | JP Morgan | (3.294) | 740 | Holcim AG | Bank of America | |
| | | | 166.336 | 675 | Holcim AG | Merrill Lynch | (1.816) |
| Schweiz | | | | 7.378 | Holcim AG | Barclays Bank | (1.145) |
| (11.404) | ABB Ltd Reg | Barclays Bank | (125) | 253 | Holcim AG | BNP Paribas | (18.109) |
| (825) | Adecco Group AG Reg | Bank of America | | 1.348 | Holcim AG | HSBC | (1.103) |
| | | Merrill Lynch | 1.790 | 1.348 | Julius Baer Group Ltd | Bank of America | |
| (1.210) | Adecco Group AG Reg | Barclays Bank | 2.108 | 700 | Julius Baer Group Ltd | Merrill Lynch | (9.630) |
| (9) | Adecco Group AG Reg | BNP Paribas | 20 | 84 | Julius Baer Group Ltd | Goldman Sachs | (5.001) |
| (1.052) | Adecco Group AG Reg | Goldman Sachs | 2.282 | 1.494 | Kuehne + Nagel International AG Reg | HSBC | (628) |
| (211) | Alcon Inc | HSBC | (1.077) | 93 | Kuehne + Nagel International AG Reg | Barclays Bank | (3.929) |
| (112) | Bachem Holding AG | Bank of America | | 85 | Kuehne + Nagel International AG Reg | Citibank | (256) |
| | | Merrill Lynch | 160 | 107 | Kuehne + Nagel International AG Reg | HSBC | (1.285) |
| (48) | Bachem Holding AG | Barclays Bank | 79 | 187 | Logitech International SA Reg | JP Morgan | (1.618) |
| (2.157) | Bachem Holding AG | BNP Paribas | 3.072 | 469 | Logitech International SA Reg | Barclays Bank | (105) |
| (165) | Bachem Holding AG | HSBC | 1.473 | (129) | Lonza Group AG Reg | Citibank | (130) |
| 222 | Baloise Holding AG Reg | Bank of America | | (113) | Lonza Group AG Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 170 | (241) | Lonza Group AG Reg | Merrill Lynch | 2.064 |
| 286 | Baloise Holding AG Reg | Barclays Bank | (345) | (55) | Lonza Group AG Reg | Barclays Bank | 916 |
| 371 | Baloise Holding AG Reg | Goldman Sachs | 285 | (32) | Lonza Group AG Reg | BNP Paribas | 3.855 |
| 103 | Baloise Holding AG Reg | HSBC | (34) | (98) | Lonza Group AG Reg | Citibank | (188) |
| (278) | Banque Cantonale Vaudoise Reg | Bank of America | | 638 | Lonza Group AG Reg | Goldman Sachs | 512 |
| | | Merrill Lynch | (1.295) | 719 | Nestle SA Reg | HSBC | 902 |
| (666) | Banque Cantonale Vaudoise Reg | Barclays Bank | (1.605) | 679 | Nestle SA Reg | Barclays Bank | (2.412) |
| (1.503) | Banque Cantonale Vaudoise Reg | BNP Paribas | (6.999) | 50 | Novartis AG Reg | BNP Paribas | (4.648) |
| (13) | Banque Cantonale Vaudoise Reg | Citibank | (31) | 504 | Novartis AG Reg | Citibank | 184 |
| (1.314) | Banque Cantonale Vaudoise Reg | Goldman Sachs | (6.119) | 1.263 | Novartis AG Reg | Goldman Sachs | (4.390) |
| (598) | Banque Cantonale Vaudoise Reg | HSBC | (2.555) | 145 | Novartis AG Reg | Bank of America | |
| (47) | Barry Callebaut AG Reg | Barclays Bank | 3.914 | 2.069 | Novartis AG Reg | Merrill Lynch | (255) |
| (12) | Barry Callebaut AG Reg | BNP Paribas | 1.433 | 1.470 | Novartis AG Reg | Barclays Bank | 438 |
| (22) | Barry Callebaut AG Reg | Citibank | 1.832 | 36 | Partners Group Holding AG | BNP Paribas | (6.449) |
| (28) | Barry Callebaut AG Reg | Goldman Sachs | 3.344 | 44 | Partners Group Holding AG | Citibank | (117) |
| 4 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | Bank of America | | 51 | Partners Group Holding AG | Goldman Sachs | (308) |
| | | Merrill Lynch | (1.315) | 13 | Partners Group Holding AG | HSBC | (1.665) |
| 2 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | Barclays Bank | (351) | 12 | Partners Group Holding AG | JP Morgan | (1.432) |
| 5 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | BNP Paribas | (1.644) | 50 | Partners Group Holding AG | Bank of America | |
| 3 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | HSBC | (1.019) | 43 | Partners Group Holding AG | Merrill Lynch | 1.056 |
| 2 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | JP Morgan | (679) | 338 | Roche Holding AG | Barclays Bank | 341 |
| 573 | Clariant AG Reg | Bank of America | | 444 | Roche Holding AG | BNP Paribas | 403 |
| | | Merrill Lynch | (553) | 129 | Roche Holding AG | Goldman Sachs | 665 |
| 1.330 | Clariant AG Reg | Barclays Bank | (1.020) | 213 | Roche Holding AG | HSBC | 1.026 |
| 1.390 | Clariant AG Reg | BNP Paribas | (1.340) | 312 | Roche Holding AG | HSBC | 1.026 |
| 1.361 | Clariant AG Reg | Citibank | (1.044) | (391) | Schindler Holding AG | Barclays Bank | 3.192 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht |
|----------------------------|---------------------------|-----------------|---|-----------------------------------|-------------------------|-----------------|---|
| | | | realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | | | | realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD |
| Schweiz Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (57) | Schindler Holding AG | BNP Paribas | 518 | 836 | 3i Group Plc | JP Morgan | 1.904 |
| (221) | Schindler Holding AG | Goldman Sachs | 2.010 | (9.632) | abrdn Plc | Bank of America | |
| (9) | Schindler Holding AG | HSBC | 101 | | | Merrill Lynch | 835 |
| (175) | SGS SA Reg | Citibank | (104) | (22.225) | abrdn Plc | Barclays Bank | 3.357 |
| (450) | SGS SA Reg | Goldman Sachs | (473) | (16.729) | abrdn Plc | BNP Paribas | 1.450 |
| (200) | SGS SA Reg | HSBC | 26 | (20.689) | abrdn Plc | Goldman Sachs | 1.793 |
| (2.130) | SIG Group AG | Bank of America | | (1.466) | Admiral Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 560 | | | Merrill Lynch | (1.742) |
| (1.277) | SIG Group AG | Barclays Bank | 896 | (1.029) | Admiral Group Plc | BNP Paribas | (1.223) |
| (3.684) | SIG Group AG | BNP Paribas | 969 | (1.993) | Admiral Group Plc | Goldman Sachs | (2.368) |
| (438) | SIG Group AG | Citibank | 307 | (1.812) | Admiral Group Plc | HSBC | (2.714) |
| (2.415) | SIG Group AG | Goldman Sachs | 635 | 2.879 | Anglo American Plc | Barclays Bank | (2.699) |
| (1.397) | SIG Group AG | HSBC | 1.439 | (2.383) | Antofagasta Plc | Bank of America | |
| (722) | SIG Group AG | JP Morgan | 744 | | | Merrill Lynch | 1.858 |
| 84 | Sika AG Reg | BNP Paribas | (64) | (3.593) | Antofagasta Plc | Barclays Bank | 3.136 |
| 115 | Sika AG Reg | Goldman Sachs | (88) | (2.710) | Antofagasta Plc | BNP Paribas | 2.113 |
| (92) | Sonova Holding AG Reg | Barclays Bank | 1.197 | (756) | Antofagasta Plc | Goldman Sachs | 590 |
| (85) | Sonova Holding AG Reg | BNP Paribas | 4.107 | (808) | Antofagasta Plc | HSBC | 1.060 |
| 137 | Straumann Holding AG Reg | Barclays Bank | (1.111) | 278 | Ashtead Group Plc | Citibank | (458) |
| 3 | Straumann Holding AG Reg | HSBC | (24) | 106 | Associated British | | |
| 113 | Swatch Group AG | Bank of America | | | Foods Plc | Goldman Sachs | (93) |
| | | Merrill Lynch | (3.244) | 555 | Associated British | | |
| 44 | Swatch Group AG | Barclays Bank | (877) | | Foods Plc | HSBC | (622) |
| 228 | Swatch Group AG | BNP Paribas | (6.545) | (346) | AstraZeneca Plc | Bank of America | |
| 30 | Swatch Group AG | Citibank | (598) | | | Merrill Lynch | 1.388 |
| 33 | Swatch Group AG | Goldman Sachs | (947) | (1.046) | AstraZeneca Plc | Barclays Bank | 4.661 |
| 43 | Swiss Life Holding AG Reg | Bank of America | | (1.003) | AstraZeneca Plc | BNP Paribas | 4.023 |
| | | Merrill Lynch | (396) | (541) | AstraZeneca Plc | Citibank | 2.411 |
| 91 | Swiss Life Holding AG Reg | Barclays Bank | (518) | (125) | AstraZeneca Plc | Goldman Sachs | 501 |
| 231 | Swiss Life Holding AG Reg | Goldman Sachs | (2.126) | (208) | AstraZeneca Plc | HSBC | 613 |
| 28 | Swiss Life Holding AG Reg | HSBC | (792) | 1.562 | Auto Trader Group Plc | Bank of America | |
| 48 | Swiss Life Holding AG Reg | JP Morgan | (1.357) | | | Merrill Lynch | (35) |
| (400) | Swiss Prime Site AG Reg | Bank of America | | 10.059 | Auto Trader Group Plc | Barclays Bank | (573) |
| | | Merrill Lynch | 1.753 | 18.251 | Auto Trader Group Plc | BNP Paribas | (407) |
| (437) | Swiss Prime Site AG Reg | Barclays Bank | 1.484 | 7.214 | Auto Trader Group Plc | Citibank | 33 |
| (870) | Swiss Prime Site AG Reg | BNP Paribas | 3.813 | 15.443 | Auto Trader Group Plc | Goldman Sachs | (344) |
| (231) | Swiss Prime Site AG Reg | Citibank | 785 | 3.071 | Auto Trader Group Plc | HSBC | 281 |
| (226) | Swiss Prime Site AG Reg | Goldman Sachs | 991 | 5.680 | Auto Trader Group Plc | JP Morgan | 520 |
| (450) | Swiss Prime Site AG Reg | HSBC | 1.775 | (8.958) | Aviva Plc | BNP Paribas | 1.730 |
| (116) | Swiss Prime Site AG Reg | JP Morgan | 458 | (7.203) | Aviva Plc | Goldman Sachs | 1.391 |
| (371) | Swiss Re AG | Bank of America | | 55.707 | Barclays Plc | BNP Paribas | (2.262) |
| | | Merrill Lynch | (1.049) | 64.589 | Barclays Plc | Citibank | (5.813) |
| (766) | Swiss Re AG | Barclays Bank | (1.007) | 18.560 | Barclays Plc | Goldman Sachs | (754) |
| (576) | Swiss Re AG | Goldman Sachs | (1.628) | 186 | Berkeley Group | | |
| 18 | Swisscom AG Reg | Bank of America | | | Holdings Plc | Barclays Bank | (711) |
| | | Merrill Lynch | (316) | 183 | Berkeley Group | | |
| 239 | Swisscom AG Reg | Barclays Bank | (1.152) | | Holdings Plc | Citibank | (700) |
| 103 | Swisscom AG Reg | BNP Paribas | (1.806) | 4.977 | BP Plc | Barclays Bank | (1.244) |
| 55 | Swisscom AG Reg | Citibank | (88) | 51.131 | BP Plc | BNP Paribas | (16.995) |
| 16 | Swisscom AG Reg | Goldman Sachs | (281) | 11.689 | BP Plc | Citibank | (2.153) |
| 18 | Swisscom AG Reg | JP Morgan | (462) | 12.318 | BP Plc | Goldman Sachs | (4.094) |
| (743) | Temenos AG Reg | Barclays Bank | 286 | (55.051) | BT Group Plc | BNP Paribas | 3.544 |
| (179) | Temenos AG Reg | Citibank | (58) | (15.619) | BT Group Plc | Goldman Sachs | 1.005 |
| 326 | UBS Group AG Reg | Barclays Bank | (291) | (18.626) | BT Group Plc | HSBC | 1.303 |
| 8.558 | UBS Group AG Reg | BNP Paribas | 281 | (346) | Bunzl Plc | Bank of America | |
| 16 | UBS Group AG Reg | Citibank | (14) | | | Merrill Lynch | (26) |
| 1.589 | UBS Group AG Reg | Goldman Sachs | 52 | (413) | Bunzl Plc | Barclays Bank | (133) |
| 2.080 | UBS Group AG Reg | HSBC | (479) | (1.199) | Bunzl Plc | BNP Paribas | (89) |
| 33 | VAT Group AG | Barclays Bank | 1.522 | (380) | Bunzl Plc | Citibank | (122) |
| 75 | VAT Group AG | BNP Paribas | 4.528 | (354) | Bunzl Plc | Goldman Sachs | (26) |
| 119 | VAT Group AG | Citibank | 5.130 | 370 | Burberry Group Plc | Bank of America | |
| 34 | VAT Group AG | Goldman Sachs | 2.053 | | | Merrill Lynch | (1.713) |
| | | | (87.174) | 1.361 | Burberry Group Plc | BNP Paribas | (6.301) |
| | | | | 1.176 | Burberry Group Plc | Goldman Sachs | (5.445) |
| | | | | 1.187 | Burberry Group Plc | HSBC | (5.393) |
| | | | | 843 | Burberry Group Plc | JP Morgan | (3.830) |
| | | | | 438 | Coca-Cola HBC AG | Barclays Bank | (694) |
| 612 | 3i Group Plc | Bank of America | | 4.250 | Coca-Cola HBC AG | BNP Paribas | (8.049) |
| | | Merrill Lynch | 595 | 1.667 | Compass Group Plc | Citibank | 158 |
| 1.256 | 3i Group Plc | Barclays Bank | 132 | (107) | Croda International Plc | Barclays Bank | 134 |
| 3.106 | 3i Group Plc | BNP Paribas | 3.018 | | | | |
| 1.106 | 3i Group Plc | Citibank | 116 | | | | |
| 3.336 | 3i Group Plc | HSBC | 7.599 | | | | |
| Großbritannien | | | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------|---|-----------------------------------|-----------------------------|-----------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (305) | Croda International Plc | Citibank | 32 | 3.654 | M&G Plc | BNP Paribas | 32 |
| 668 | DCC Plc | BNP Paribas | (372) | 9.855 | M&G Plc | Citibank | (24) |
| (1.254) | Diageo Plc | Bank of America | | 4.717 | Melrose Industries Plc | Barclays Bank | (409) |
| | | Merrill Lynch | 2.592 | 5.212 | Melrose Industries Plc | Goldman Sachs | 594 |
| (2.965) | Diageo Plc | Barclays Bank | 6.295 | 4.420 | Melrose Industries Plc | HSBC | 2.687 |
| (1.245) | Diageo Plc | Citibank | 2.643 | 1.191 | Mondi Plc | Barclays Bank | (627) |
| 4.717 | Dowlais Group Plc | Barclays Bank | (651) | 1.121 | Mondi Plc | BNP Paribas | (687) |
| 5.212 | Dowlais Group Plc | Goldman Sachs | 242 | 256 | Mondi Plc | HSBC | (120) |
| 4.420 | Dowlais Group Plc | HSBC | 402 | (4.238) | National Grid Plc | Bank of America | |
| (997) | Entain Plc | BNP Paribas | 1.765 | | | Merrill Lynch | 2.807 |
| (541) | Entain Plc | Citibank | 1.025 | (4.400) | National Grid Plc | Barclays Bank | (109) |
| (544) | Entain Plc | Goldman Sachs | 963 | (13.575) | National Grid Plc | BNP Paribas | 8.990 |
| (665) | Entain Plc | JP Morgan | 1.309 | (4.406) | National Grid Plc | Citibank | (109) |
| 52 | GSK Plc | Bank of America | | (1.453) | National Grid Plc | Goldman Sachs | 962 |
| | | Merrill Lynch | (75) | (2.078) | National Grid Plc | HSBC | 1.183 |
| 6.871 | GSK Plc | Barclays Bank | (6.209) | (4.282) | National Grid Plc | JP Morgan | 2.438 |
| 3.597 | GSK Plc | BNP Paribas | (5.201) | 5.238 | NatWest Group Plc | Barclays Bank | (707) |
| 2.574 | GSK Plc | Citibank | (2.326) | 28.177 | NatWest Group Plc | BNP Paribas | (1.465) |
| 668 | GSK Plc | Goldman Sachs | (966) | 3.265 | NatWest Group Plc | Citibank | (441) |
| 480 | GSK Plc | HSBC | (555) | 20.600 | NatWest Group Plc | Goldman Sachs | (1.071) |
| (2.307) | Haleon Plc | Bank of America | | 3.222 | NatWest Group Plc | HSBC | (44) |
| | | Merrill Lynch | 725 | 3.399 | NatWest Group Plc | JP Morgan | (46) |
| (6.029) | Haleon Plc | Barclays Bank | 1.433 | 293 | Next Plc | Citibank | (878) |
| (10.966) | Haleon Plc | BNP Paribas | 3.448 | 125 | Next Plc | HSBC | (607) |
| (3.929) | Haleon Plc | Citibank | 934 | (1.813) | Ocado Group Plc | Bank of America | |
| (12.105) | Haleon Plc | Goldman Sachs | 3.806 | | | Merrill Lynch | 1.347 |
| (5.187) | Haleon Plc | JP Morgan | 1.188 | (6.547) | Ocado Group Plc | Barclays Bank | 1.989 |
| (773) | Halma Plc | Bank of America | | (12.259) | Ocado Group Plc | BNP Paribas | 9.105 |
| | | Merrill Lynch | 478 | (4.234) | Ocado Group Plc | Goldman Sachs | 3.145 |
| (5.762) | Hargreaves Lansdown Plc | BNP Paribas | 128 | (3.764) | Ocado Group Plc | HSBC | 4.846 |
| (9.446) | Hargreaves Lansdown Plc | Goldman Sachs | 210 | (1.497) | Pearson Plc | Bank of America | |
| (4.737) | Hargreaves Lansdown Plc | HSBC | (926) | | | Merrill Lynch | 315 |
| (1.679) | Hikma Pharmaceuticals Plc | Bank of America | | (4.229) | Pearson Plc | Barclays Bank | 444 |
| | | Merrill Lynch | 686 | (6.067) | Pearson Plc | BNP Paribas | 1.277 |
| (2.708) | Hikma Pharmaceuticals Plc | Barclays Bank | 872 | (7.322) | Pearson Plc | Citibank | 1.386 |
| (357) | Hikma Pharmaceuticals Plc | BNP Paribas | 146 | (1.134) | Persimmon Plc | Bank of America | |
| (1.431) | Hikma Pharmaceuticals Plc | HSBC | 779 | | | Merrill Lynch | 1.874 |
| (1.746) | HSBC Holdings Plc | Barclays Bank | 519 | (2.248) | Persimmon Plc | Barclays Bank | 2.922 |
| (5.059) | HSBC Holdings Plc | BNP Paribas | 1.115 | (5.527) | Persimmon Plc | BNP Paribas | 9.134 |
| 2.994 | Informa Plc | Bank of America | | (1.111) | Persimmon Plc | Citibank | 1.444 |
| | | Merrill Lynch | 15 | (3.423) | Persimmon Plc | Goldman Sachs | 5.657 |
| 1.567 | Informa Plc | Barclays Bank | (539) | (964) | Persimmon Plc | HSBC | 1.581 |
| 6.078 | Informa Plc | BNP Paribas | 30 | (5.260) | Phoenix Group Holdings Plc | BNP Paribas | 951 |
| 94 | Informa Plc | Citibank | (32) | (1.139) | Prudential Plc | Bank of America | |
| 1.640 | Informa Plc | Goldman Sachs | 8 | | | Merrill Lynch | 1.502 |
| 3.592 | Informa Plc | HSBC | 89 | (5.547) | Prudential Plc | Barclays Bank | 7.374 |
| 2.539 | Informa Plc | JP Morgan | 63 | (7.820) | Prudential Plc | BNP Paribas | 10.310 |
| 1.019 | InterContinental Hotels Group Plc | Barclays Bank | (984) | (688) | Prudential Plc | Goldman Sachs | 907 |
| 216 | InterContinental Hotels Group Plc | BNP Paribas | 16 | (2.141) | Prudential Plc | HSBC | 2.915 |
| 614 | InterContinental Hotels Group Plc | Goldman Sachs | 46 | (592) | Reckitt Benckiser Group Plc | Bank of America | |
| (407) | Intertek Group Plc | Barclays Bank | (45) | (688) | Reckitt Benckiser Group Plc | Merrill Lynch | 1.612 |
| 5.196 | J Sainsbury Plc | Goldman Sachs | (1.048) | (18) | Reckitt Benckiser Group Plc | Barclays Bank | 1.993 |
| 956 | Johnson Matthey Plc | Bank of America | | (963) | Reckitt Benckiser Group Plc | Goldman Sachs | 49 |
| | | Merrill Lynch | (2.414) | (239) | Reckitt Benckiser Group Plc | HSBC | 2.122 |
| 378 | Johnson Matthey Plc | Barclays Bank | (840) | 538 | Reckitt Benckiser Group Plc | JP Morgan | 527 |
| 761 | Johnson Matthey Plc | BNP Paribas | (1.922) | | RELX Plc | Bank of America | |
| 761 | Johnson Matthey Plc | JP Morgan | (1.743) | 2.659 | RELX Plc | Merrill Lynch | 420 |
| (19.371) | Kingfisher Plc | Barclays Bank | 1.344 | 1.400 | RELX Plc | Barclays Bank | 1.415 |
| 12.748 | Legal & General Group Plc | BNP Paribas | (473) | 538 | RELX Plc | BNP Paribas | 1.092 |
| 209 | London Stock Exchange Group Plc | Barclays Bank | 191 | 2.547 | RELX Plc | Citibank | 286 |
| 138 | London Stock Exchange Group Plc | BNP Paribas | 154 | 2.547 | RELX Plc | Goldman Sachs | 1.986 |
| 369 | London Stock Exchange Group Plc | Goldman Sachs | 411 | 1.104 | RELX Plc | HSBC | 806 |
| 416 | London Stock Exchange Group Plc | HSBC | 855 | (13.409) | Rentokil Initial Plc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 930 |
| | | | | (24.993) | Rentokil Initial Plc | Barclays Bank | (970) |
| | | | | (22.381) | Rentokil Initial Plc | BNP Paribas | 1.552 |
| | | | | (9.783) | Rentokil Initial Plc | Citibank | (938) |
| | | | | (22.654) | Rentokil Initial Plc | Goldman Sachs | 1.570 |
| | | | | (8.692) | Rentokil Initial Plc | HSBC | (473) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|------------------------------|-----------------|---|---------------------------------------|----------------------------|-----------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| 145 | Rio Tinto Plc | Bank of America | | 23.888 | Taylor Wimpey Plc | HSBC | (3.016) |
| | | Merrill Lynch | (275) | 12.437 | Taylor Wimpey Plc | JP Morgan | (1.570) |
| 498 | Rio Tinto Plc | Barclays Bank | (780) | 194 | Unilever Plc | BNP Paribas | (677) |
| 791 | Rio Tinto Plc | BNP Paribas | (1.498) | 290 | Unilever Plc | Citibank | 22 |
| 263 | Rio Tinto Plc | Citibank | (99) | 976 | Unilever Plc | Goldman Sachs | (3.407) |
| (18.851) | Rolls-Royce Holdings Plc | Goldman Sachs | 350 | (38) | United Utilities Group Plc | Bank of America | |
| 2.589 | Sage Group Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 22 |
| | | Merrill Lynch | 1.878 | (2.043) | United Utilities Group Plc | Goldman Sachs | 1.189 |
| 10.097 | Sage Group Plc | Barclays Bank | 900 | (88.913) | Vodafone Group Plc | Bank of America | |
| 15.439 | Sage Group Plc | BNP Paribas | 11.200 | | | Merrill Lynch | 13.780 |
| 9.586 | Sage Group Plc | Citibank | 854 | (20.053) | Vodafone Group Plc | Goldman Sachs | 3.108 |
| 9.766 | Sage Group Plc | Goldman Sachs | 7.084 | (72.110) | Vodafone Group Plc | HSBC | 14.970 |
| 5.443 | Sage Group Plc | HSBC | 4.582 | 270 | Whitbread Plc | Barclays Bank | (60) |
| 5.203 | Sage Group Plc | JP Morgan | 4.380 | 930 | Whitbread Plc | Goldman Sachs | 437 |
| (5.092) | Schroders Plc | Bank of America | | 957 | WPP Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.002 | | | Merrill Lynch | (339) |
| (20.222) | Schroders Plc | Barclays Bank | 3.739 | 3.284 | WPP Plc | Barclays Bank | (1.325) |
| (16.981) | Schroders Plc | BNP Paribas | 3.342 | 9.814 | WPP Plc | BNP Paribas | (3.475) |
| (13.203) | Schroders Plc | Citibank | 1.694 | 2.052 | WPP Plc | Goldman Sachs | (726) |
| (15.766) | Schroders Plc | Goldman Sachs | 3.103 | 6.181 | WPP Plc | HSBC | (2.494) |
| (12.897) | Schroders Plc | HSBC | 2.267 | | | | 109.900 |
| (5.215) | Schroders Plc | JP Morgan | 917 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| (1.860) | Severn Trent Plc | Bank of America | | 114 | 3M Co | Barclays Bank | (282) |
| | | Merrill Lynch | 2.740 | 225 | A O Smith Corp | Bank of America | |
| (2.358) | Severn Trent Plc | Barclays Bank | 292 | | | Merrill Lynch | (684) |
| (4.228) | Severn Trent Plc | BNP Paribas | 6.228 | 1.308 | A O Smith Corp | Barclays Bank | (3.963) |
| (3.038) | Severn Trent Plc | Goldman Sachs | 4.475 | 102 | A O Smith Corp | BNP Paribas | (310) |
| (845) | Severn Trent Plc | HSBC | 1.632 | 793 | A O Smith Corp | Citibank | (2.168) |
| 3.334 | Shell Plc | Barclays Bank | (3.575) | 341 | A O Smith Corp | Goldman Sachs | (1.037) |
| 13.950 | Shell Plc | BNP Paribas | (29.961) | 467 | A O Smith Corp | HSBC | (2.258) |
| 1.737 | Shell Plc | Citibank | (2.326) | (1.170) | Abbott Laboratories | Bank of America | |
| 1.216 | Shell Plc | Goldman Sachs | (2.612) | | | Merrill Lynch | 10.366 |
| (916) | Smith & Nephew Plc | Bank of America | | (706) | Abbott Laboratories | Barclays Bank | 5.133 |
| | | Merrill Lynch | 924 | (317) | Abbott Laboratories | Citibank | 2.305 |
| (7.434) | Smith & Nephew Plc | Barclays Bank | 6.970 | (413) | Abbott Laboratories | JP Morgan | 4.097 |
| (8.326) | Smith & Nephew Plc | BNP Paribas | 8.400 | 105 | AbbVie Inc | Bank of America | |
| (12.386) | Smith & Nephew Plc | Citibank | 6.495 | | | Merrill Lynch | (1.115) |
| (4.191) | Smith & Nephew Plc | Goldman Sachs | 4.228 | 75 | AbbVie Inc | Goldman Sachs | (797) |
| (740) | Smith & Nephew Plc | HSBC | 504 | 86 | Accenture Plc 'A' | Bank of America | |
| (673) | Smith & Nephew Plc | JP Morgan | 458 | | | Merrill Lynch | 2.467 |
| 10.935 | Smiths Group Plc | Barclays Bank | (8.934) | 54 | Accenture Plc 'A' | Barclays Bank | 824 |
| 1.610 | Smiths Group Plc | BNP Paribas | (727) | 43 | Accenture Plc 'A' | Citibank | 656 |
| 12.059 | Smiths Group Plc | Goldman Sachs | (5.449) | 243 | Accenture Plc 'A' | Goldman Sachs | 6.972 |
| 1.199 | Smiths Group Plc | HSBC | (698) | 156 | Accenture Plc 'A' | JP Morgan | 6.455 |
| 138 | Smiths Group Plc | JP Morgan | (80) | 316 | Adobe Inc | Bank of America | |
| (208) | Spirax-Sarco Engineering Plc | Goldman Sachs | 322 | | | Merrill Lynch | 22.003 |
| 2.916 | SSE Plc | Barclays Bank | 433 | 696 | Adobe Inc | Barclays Bank | 30.102 |
| 192 | SSE Plc | BNP Paribas | (29) | 112 | Adobe Inc | BNP Paribas | 7.799 |
| 2.106 | SSE Plc | Goldman Sachs | (313) | 378 | Adobe Inc | Goldman Sachs | 26.320 |
| 492 | SSE Plc | HSBC | 143 | (316) | Advance Auto Parts Inc | Bank of America | |
| 1.097 | St James's Place Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 14.214 |
| | | Merrill Lynch | (122) | (943) | Advance Auto Parts Inc | Barclays Bank | 39.324 |
| 4.046 | St James's Place Plc | Barclays Bank | (1.578) | (482) | Advance Auto Parts Inc | Goldman Sachs | 21.680 |
| 2.395 | St James's Place Plc | BNP Paribas | (267) | (134) | Advance Auto Parts Inc | HSBC | 6.537 |
| 850 | St James's Place Plc | Citibank | (331) | (629) | Advanced Micro Devices Inc | Barclays Bank | (8.897) |
| 2.783 | St James's Place Plc | Goldman Sachs | (310) | (310) | Advanced Micro Devices Inc | HSBC | (8.403) |
| 2.250 | St James's Place Plc | HSBC | (139) | 138 | AECOM | Bank of America | |
| 2.243 | St James's Place Plc | JP Morgan | (139) | | | Merrill Lynch | (275) |
| (2.907) | Standard Chartered Plc | Bank of America | | 119 | AECOM | Citibank | (231) |
| | | Merrill Lynch | (655) | 249 | AECOM | Goldman Sachs | (496) |
| (8.291) | Standard Chartered Plc | BNP Paribas | (1.868) | 157 | AECOM | HSBC | (791) |
| (1.086) | Standard Chartered Plc | Citibank | 215 | 115 | AECOM | JP Morgan | (580) |
| (2.746) | Standard Chartered Plc | Goldman Sachs | (619) | 454 | AerCap Holdings NV | Bank of America | |
| 14.430 | Taylor Wimpey Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (263) |
| | | Merrill Lynch | (2.144) | 631 | AerCap Holdings NV | BNP Paribas | (366) |
| 38.886 | Taylor Wimpey Plc | Barclays Bank | (5.127) | (149) | Aflac Inc | Bank of America | |
| 28.306 | Taylor Wimpey Plc | BNP Paribas | (4.205) | | | Merrill Lynch | 216 |
| 24.622 | Taylor Wimpey Plc | Citibank | (3.246) | (157) | Aflac Inc | BNP Paribas | 228 |
| | | | | (149) | Aflac Inc | Citibank | 289 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (332) | Aflac Inc | Goldman Sachs | 481 | (110) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 1.970 |
| (150) | Aflac Inc | HSBC | 450 | (49) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | HSBC | 1.062 |
| (385) | Aflac Inc | JP Morgan | 1.155 | (113) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | JP Morgan | 2.449 |
| 1.052 | Agilent Technologies Inc | Barclays Bank | (12.658) | 1.495 | Alphabet Inc 'A' | Barclays Bank | (2.627) |
| 532 | Agilent Technologies Inc | BNP Paribas | (6.693) | 224 | Alphabet Inc 'A' | Citibank | (250) |
| 192 | Agilent Technologies Inc | Citibank | (1.720) | 230 | Alphabet Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.523 |
| 781 | Agilent Technologies Inc | Goldman Sachs | (9.825) | (605) | Amazon.com Inc | Barclays Bank | (4.096) |
| 1.483 | Agilent Technologies Inc | HSBC | (25.270) | (181) | Amazon.com Inc | BNP Paribas | (1.915) |
| 270 | Agilent Technologies Inc | JP Morgan | (4.601) | (210) | Amazon.com Inc | Citibank | (392) |
| (68) | Air Products and Chemicals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 577 | (269) | Amazon.com Inc | Goldman Sachs | (2.846) |
| (201) | Air Products and Chemicals Inc | Barclays Bank | 844 | (606) | Amazon.com Inc | HSBC | (9.666) |
| (320) | Air Products and Chemicals Inc | BNP Paribas | 2.717 | 191 | American Express Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.614 |
| (458) | Air Products and Chemicals Inc | Citibank | 1.665 | 297 | American Express Co | Barclays Bank | 1.348 |
| (934) | Air Products and Chemicals Inc | Goldman Sachs | 7.930 | 801 | American Express Co | BNP Paribas | 6.768 |
| (65) | Air Products and Chemicals Inc | HSBC | 1.611 | 630 | American Express Co | Citibank | 2.598 |
| 422 | Airbnb Inc 'A' | Barclays Bank | (2.161) | 549 | American Express Co | Goldman Sachs | 4.639 |
| 914 | Airbnb Inc 'A' | BNP Paribas | (887) | 46 | American Express Co | HSBC | 249 |
| 159 | Airbnb Inc 'A' | Goldman Sachs | (154) | 242 | American Express Co | JP Morgan | 1.309 |
| 188 | Airbnb Inc 'A' | HSBC | (3.918) | 411 | American International Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 612 |
| 27 | Airbnb Inc 'A' | JP Morgan | (563) | 2.836 | American International Group Inc | Barclays Bank | 199 |
| 196 | Akamai Technologies Inc | Barclays Bank | 888 | 3.429 | American International Group Inc | BNP Paribas | 5.109 |
| (216) | Albemarle Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.216 | 179 | American International Group Inc | Citibank | 13 |
| (231) | Albemarle Corp | Barclays Bank | 1.936 | 1.841 | American International Group Inc | Goldman Sachs | 2.743 |
| (80) | Albemarle Corp | BNP Paribas | 450 | 448 | American International Group Inc | HSBC | 125 |
| (186) | Albemarle Corp | Goldman Sachs | 1.047 | (393) | American Water Works Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.776 |
| (93) | Albemarle Corp | HSBC | (1.138) | (379) | American Water Works Co Inc | Barclays Bank | 201 |
| (224) | Alcoa Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.122 | (313) | American Water Works Co Inc | BNP Paribas | 1.415 |
| (883) | Alcoa Corp | Barclays Bank | 3.903 | (78) | American Water Works Co Inc | Citibank | 41 |
| (961) | Alcoa Corp | BNP Paribas | 4.815 | (494) | American Water Works Co Inc | Goldman Sachs | 2.233 |
| (40) | Align Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 734 | (252) | American Water Works Co Inc | HSBC | 1.116 |
| (3) | Align Technology Inc | Barclays Bank | 66 | 40 | Ameriprise Financial Inc | Barclays Bank | (106) |
| (61) | Align Technology Inc | BNP Paribas | 1.119 | 7 | Ameriprise Financial Inc | Goldman Sachs | 17 |
| (28) | Align Technology Inc | Goldman Sachs | 514 | 43 | Ameriprise Financial Inc | JP Morgan | 330 |
| (4) | Align Technology Inc | HSBC | 109 | (66) | AmerisourceBergen Corp | Bank of America Merrill Lynch | 521 |
| 573 | Allegion Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.086) | (291) | AmerisourceBergen Corp | Barclays Bank | 1.752 |
| 533 | Allegion Plc | Barclays Bank | (2.143) | (213) | AmerisourceBergen Corp | BNP Paribas | 1.681 |
| 819 | Allegion Plc | BNP Paribas | (2.981) | (115) | AmerisourceBergen Corp | Citibank | 782 |
| 402 | Allegion Plc | Citibank | (1.616) | (76) | AmerisourceBergen Corp | Goldman Sachs | 600 |
| 294 | Allegion Plc | Goldman Sachs | (1.070) | 187 | AMETEK Inc | Bank of America Merrill Lynch | (69) |
| 119 | Allegion Plc | HSBC | (224) | 1.050 | AMETEK Inc | Barclays Bank | (2.058) |
| 144 | Allegion Plc | JP Morgan | (271) | 1.072 | AMETEK Inc | BNP Paribas | (397) |
| (350) | Allstate Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.835 | 518 | AMETEK Inc | Citibank | (1.015) |
| (1.499) | Allstate Corp | BNP Paribas | 12.142 | 582 | AMETEK Inc | Goldman Sachs | (215) |
| (523) | Allstate Corp | Citibank | 4.320 | 928 | AMETEK Inc | HSBC | 882 |
| (562) | Allstate Corp | Goldman Sachs | 4.552 | 256 | AMETEK Inc | JP Morgan | 243 |
| (183) | Allstate Corp | HSBC | 1.151 | 46 | Amgen Inc | Barclays Bank | (251) |
| (124) | Allstate Corp | JP Morgan | 780 | 228 | Amgen Inc | BNP Paribas | (3.420) |
| (1.356) | Ally Financial Inc | Barclays Bank | (149) | 171 | Amgen Inc | Goldman Sachs | (2.565) |
| (1.429) | Ally Financial Inc | BNP Paribas | (2.043) | (312) | Amphenol Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (106) |
| (928) | Ally Financial Inc | Citibank | (102) | (1.708) | Amphenol Corp 'A' | Barclays Bank | 359 |
| (355) | Ally Financial Inc | Goldman Sachs | (508) | (4.933) | Amphenol Corp 'A' | BNP Paribas | (1.677) |
| (248) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.442 | (328) | Amphenol Corp 'A' | Citibank | 69 |
| (151) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | 720 | | | | |
| (215) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | BNP Paribas | 3.851 | | | | |
| (49) | Alnylam Pharmaceuticals Inc | Citibank | 234 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (387) | Amphenol Corp 'A' | Goldman Sachs | (132) | (803) | Aspen Technology Inc | BNP Paribas | 2.738 |
| (513) | Amphenol Corp 'A' | HSBC | (374) | (538) | Aspen Technology Inc | Citibank | 2.910 |
| (425) | Amphenol Corp 'A' | JP Morgan | (310) | (497) | Aspen Technology Inc | Goldman Sachs | 1.695 |
| (299) | Analog Devices Inc | Bank of America | | (114) | Aspen Technology Inc | HSBC | 941 |
| | | Merrill Lynch | 1.899 | (679) | Assurant Inc | BNP Paribas | 6.260 |
| (762) | Analog Devices Inc | Barclays Bank | 5.836 | (74) | Assurant Inc | Citibank | 572 |
| (125) | Analog Devices Inc | BNP Paribas | 794 | (82) | Assurant Inc | Goldman Sachs | 756 |
| (100) | Analog Devices Inc | Citibank | 1.329 | (1.562) | AT&T Inc | Bank of America | |
| (136) | Analog Devices Inc | Goldman Sachs | 864 | | | Merrill Lynch | 1.921 |
| 71 | ANSYS Inc | Barclays Bank | 1.447 | (1.918) | AT&T Inc | Goldman Sachs | 2.359 |
| 245 | ANSYS Inc | Goldman Sachs | 6.804 | (1.500) | AT&T Inc | HSBC | 2.100 |
| 149 | Aon Plc 'A' | Barclays Bank | (1.337) | 73 | Atlassian Corp Ltd 'A' | Bank of America | |
| 308 | Aon Plc 'A' | Citibank | (2.049) | | | Merrill Lynch | 1.998 |
| (578) | APA Corp | Citibank | 678 | 524 | Atlassian Corp Ltd 'A' | Barclays Bank | 7.519 |
| 1 | Apartment Income Corp (REIT) | Bank of America | | 86 | Atlassian Corp Ltd 'A' | Citibank | 1.234 |
| | | Merrill Lynch | (1) | 59 | Atlassian Corp Ltd 'A' | HSBC | 2.520 |
| 1 | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) [†] | Bank of America | | (104) | Atmos Energy Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | — | | | Merrill Lynch | 206 |
| (810) | Apollo Global Management Inc | Barclays Bank | (996) | (985) | Atmos Energy Corp | Barclays Bank | 749 |
| (994) | Apollo Global Management Inc | BNP Paribas | (4.026) | (691) | Atmos Energy Corp | Goldman Sachs | 1.368 |
| 234 | Apple Inc | Bank of America | | (168) | Atmos Energy Corp | HSBC | 378 |
| | | Merrill Lynch | 1.602 | 255 | Autodesk Inc | Bank of America | |
| 1.853 | Apple Inc | Barclays Bank | 8.439 | 1.604 | Autodesk Inc | Merrill Lynch | 133 |
| 779 | Apple Inc | BNP Paribas | 5.332 | 961 | Autodesk Inc | Barclays Bank | (7.610) |
| 1.444 | Apple Inc | Goldman Sachs | 9.884 | 258 | Autodesk Inc | BNP Paribas | 500 |
| 492 | Applied Materials Inc | Bank of America | | 498 | Autodesk Inc | Citibank | (1.563) |
| | | Merrill Lynch | 6.652 | 56 | Autodesk Inc | Goldman Sachs | 259 |
| 203 | Applied Materials Inc | Barclays Bank | 2.189 | 145 | Autodesk Inc | HSBC | 305 |
| 765 | Applied Materials Inc | BNP Paribas | 10.343 | 232 | Automatic Data Processing Inc | JP Morgan | 789 |
| 638 | Applied Materials Inc | Citibank | 4.020 | 57 | Automatic Data Processing Inc | Barclays Bank | (2.151) |
| 3.873 | Applied Materials Inc | Goldman Sachs | 52.363 | 406 | Automatic Data Processing Inc | BNP Paribas | (406) |
| 1.003 | Applied Materials Inc | HSBC | 18.937 | 49 | Automatic Data Processing Inc | Citibank | (3.764) |
| 83 | Applied Materials Inc | JP Morgan | 1.567 | 55 | Automatic Data Processing Inc | Goldman Sachs | (349) |
| (1.149) | Aptiv Plc | Barclays Bank | 7.170 | 11 | AutoZone Inc | HSBC | (386) |
| (1.582) | Aptiv Plc | BNP Paribas | 7.499 | | | Bank of America | |
| (971) | Aptiv Plc | Goldman Sachs | 4.603 | 10 | AutoZone Inc | Merrill Lynch | (4.054) |
| (281) | Aptiv Plc | HSBC | 1.624 | 29 | AutoZone Inc | Barclays Bank | (2.818) |
| (1.539) | Aramark | Bank of America | | 9 | AutoZone Inc | BNP Paribas | (10.687) |
| | | Merrill Lynch | (2.278) | 23 | AutoZone Inc | Citibank | (2.536) |
| (3.651) | Aramark | Barclays Bank | 1.168 | 2 | AutoZone Inc | Goldman Sachs | (8.476) |
| (1.869) | Aramark | BNP Paribas | (2.766) | 2 | AutoZone Inc | HSBC | (743) |
| (267) | Aramark | Citibank | 85 | (1.635) | Avantor Inc | JP Morgan | (743) |
| (2.210) | Aramark | Goldman Sachs | (3.271) | | | Bank of America | |
| (687) | Aramark | HSBC | (3.490) | (4.550) | Avantor Inc | Merrill Lynch | 327 |
| (963) | Aramark | JP Morgan | (4.892) | (4.244) | Avantor Inc | Barclays Bank | 2.195 |
| 548 | Arch Capital Group Ltd | Bank of America | | (1.090) | Avantor Inc | BNP Paribas | 849 |
| | | Merrill Lynch | (2.219) | (2.179) | Avantor Inc | Citibank | 719 |
| 841 | Arch Capital Group Ltd | Barclays Bank | (1.247) | (1.105) | Avantor Inc | Goldman Sachs | 436 |
| 382 | Arch Capital Group Ltd | BNP Paribas | (1.547) | (470) | Avantor Inc | HSBC | (88) |
| 133 | Arch Capital Group Ltd | Citibank | (326) | (77) | Avery Dennison Corp | JP Morgan | (38) |
| 1.051 | Archer-Daniels-Midland Co | Barclays Bank | (2.859) | (246) | Avery Dennison Corp | Barclays Bank | 150 |
| 3 | Archer-Daniels-Midland Co | Citibank | (8) | (70) | Axon Enterprise Inc | BNP Paribas | 2.996 |
| (123) | Ares Management Corp 'A' | Citibank | (127) | (63) | Axon Enterprise Inc | Barclays Bank | 86 |
| 402 | Arista Networks Inc | Barclays Bank | 9.970 | (52) | Axon Enterprise Inc | BNP Paribas | 727 |
| (134) | Arrow Electronics Inc | Bank of America | | (3.014) | Baker Hughes Co | Citibank | 511 |
| | | Merrill Lynch | (860) | (862) | Baker Hughes Co | Barclays Bank | 2.694 |
| (359) | Arrow Electronics Inc | Barclays Bank | (851) | (1.968) | Baker Hughes Co | BNP Paribas | 397 |
| (97) | Arrow Electronics Inc | BNP Paribas | (623) | (1.640) | Baker Hughes Co | Citibank | 1.458 |
| (187) | Arrow Electronics Inc | Citibank | (443) | (529) | Ball Corp | Goldman Sachs | 754 |
| (89) | Arrow Electronics Inc | HSBC | (718) | | | Bank of America | |
| (243) | Arthur J Gallagher & Co | Bank of America | | (1.435) | Ball Corp | Merrill Lynch | 2.841 |
| | | Merrill Lynch | 4.267 | (1.784) | Ball Corp | Barclays Bank | 3.045 |
| (1.169) | Arthur J Gallagher & Co | Barclays Bank | 16.740 | (175) | Ball Corp | BNP Paribas | 9.580 |
| (86) | Arthur J Gallagher & Co | Citibank | 1.232 | (2.181) | Ball Corp | Citibank | 532 |
| (218) | Aspen Technology Inc | Bank of America | | | | Goldman Sachs | 11.712 |
| | | Merrill Lynch | 743 | | | | |
| (876) | Aspen Technology Inc | Barclays Bank | 4.141 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (745) | Ball Corp | HSBC | 4.842 | (178) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Citibank | 1.705 |
| (2.784) | Bank of America Corp | Barclays Bank | 1.155 | (47) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Goldman Sachs | 410 |
| 1.037 | Bank of New York Mellon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (321) | (136) | Bio-Techne Corp | Bank of America Merrill Lynch | 12 |
| 988 | Bank of New York Mellon Corp | Barclays Bank | (850) | (758) | Bio-Techne Corp | Barclays Bank | 2.109 |
| 786 | Bank of New York Mellon Corp | BNP Paribas | (244) | (947) | Bio-Techne Corp | BNP Paribas | 85 |
| 847 | Bank of New York Mellon Corp | Citibank | (728) | (552) | Bio-Techne Corp | Citibank | 1.514 |
| 1.863 | Bank of New York Mellon Corp | Goldman Sachs | (578) | (277) | Bio-Techne Corp | Goldman Sachs | 25 |
| 109 | Bank of New York Mellon Corp | HSBC | (121) | (425) | Bio-Techne Corp | HSBC | 544 |
| 1.139 | Bank of New York Mellon Corp | JP Morgan | (1.264) | (160) | Blackstone Inc | Bank of America Merrill Lynch | (333) |
| (17.184) | Bank OZK | JP Morgan | (46.053) | (808) | Blackstone Inc | Barclays Bank | (162) |
| 179 | Bath & Body Works Inc | Bank of America Merrill Lynch | 338 | (712) | Blackstone Inc | BNP Paribas | (1.481) |
| 256 | Bath & Body Works Inc | BNP Paribas | 484 | (524) | Blackstone Inc | Citibank | (105) |
| 708 | Bath & Body Works Inc | Goldman Sachs | 1.338 | (418) | Blackstone Inc | Goldman Sachs | (869) |
| (1.497) | Baxter International Inc | Barclays Bank | 2.921 | (106) | Block Inc | Barclays Bank | (55) |
| (1.630) | Baxter International Inc | BNP Paribas | 4.450 | (270) | Block Inc | Citibank | (140) |
| (2.239) | Baxter International Inc | Citibank | 5.575 | (238) | Block Inc | Goldman Sachs | (1.016) |
| (2.775) | Baxter International Inc | Goldman Sachs | 7.576 | 14 | Booking Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.403) |
| (727) | Baxter International Inc | HSBC | 4.013 | 66 | Booking Holdings Inc | Barclays Bank | (9.444) |
| 45 | Becton Dickinson & Co | Barclays Bank | (549) | 75 | Booking Holdings Inc | BNP Paribas | (12.871) |
| 104 | Becton Dickinson & Co | BNP Paribas | (1.274) | 59 | Booking Holdings Inc | Goldman Sachs | (10.125) |
| 65 | Becton Dickinson & Co | HSBC | (824) | 12 | Booking Holdings Inc | JP Morgan | (1.980) |
| (529) | Bentley Systems Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (1.576) | 3 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Barclays Bank | 15 |
| (1.452) | Bentley Systems Inc 'B' | Barclays Bank | (2.773) | 277 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | BNP Paribas | 1.499 |
| (4.643) | Bentley Systems Inc 'B' | BNP Paribas | (13.836) | 210 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Goldman Sachs | 1.136 |
| (807) | Bentley Systems Inc 'B' | Citibank | (1.541) | 618 | BorgWarner Inc | Barclays Bank | (605) |
| (2.324) | Bentley Systems Inc 'B' | Goldman Sachs | (6.926) | 658 | BorgWarner Inc | BNP Paribas | 161 |
| (1.301) | Bentley Systems Inc 'B' | HSBC | (8.769) | 293 | BorgWarner Inc | HSBC | (151) |
| (247) | Bentley Systems Inc 'B' | JP Morgan | (1.665) | 935 | Boston Scientific Corp | Bank of America Merrill Lynch | (900) |
| 223 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | BNP Paribas | (729) | 845 | Boston Scientific Corp | Barclays Bank | (2.870) |
| 150 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Goldman Sachs | (491) | 215 | Boston Scientific Corp | BNP Paribas | (2.594) |
| 249 | Best Buy Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 15 | 3.097 | Bristol-Myers Squibb Co | JP Morgan | (540) |
| 474 | Best Buy Co Inc | BNP Paribas | 28 | 2.689 | Bristol-Myers Squibb Co | Barclays Bank | (3.097) |
| 298 | Best Buy Co Inc | Goldman Sachs | 18 | 1.627 | Bristol-Myers Squibb Co | BNP Paribas | (11.912) |
| 649 | Best Buy Co Inc | HSBC | 195 | 1.627 | Bristol-Myers Squibb Co | Citibank | (3.286) |
| 157 | Best Buy Co Inc | JP Morgan | 47 | 2.683 | Bristol-Myers Squibb Co | Goldman Sachs | (11.886) |
| (103) | BILL Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (259) | 535 | Bristol-Myers Squibb Co | HSBC | (2.498) |
| (647) | BILL Holdings Inc | Barclays Bank | (560) | 139 | Bristol-Myers Squibb Co | JP Morgan | (649) |
| (441) | BILL Holdings Inc | BNP Paribas | (1.107) | (35) | Broadcom Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.789) |
| (349) | BILL Holdings Inc | Goldman Sachs | (876) | (74) | Broadcom Inc | Barclays Bank | (9.385) |
| (97) | BILL Holdings Inc | HSBC | (276) | (156) | Broadridge Financial Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.328 |
| 13 | Biogen Inc | Barclays Bank | (131) | (1.026) | Broadridge Financial Solutions Inc | Barclays Bank | 7.167 |
| 306 | Biogen Inc | BNP Paribas | (4.611) | (247) | Broadridge Financial Solutions Inc | Citibank | 874 |
| 24 | Biogen Inc | Goldman Sachs | (362) | (676) | Broadridge Financial Solutions Inc | Goldman Sachs | 5.753 |
| (261) | BioMarin Pharmaceutical Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.033 | (496) | Broadridge Financial Solutions Inc | HSBC | 3.288 |
| (867) | BioMarin Pharmaceutical Inc | Barclays Bank | 3.031 | (130) | Brown & Brown Inc | Bank of America Merrill Lynch | 469 |
| (873) | BioMarin Pharmaceutical Inc | BNP Paribas | 6.801 | (1.054) | Brown & Brown Inc | Barclays Bank | 3.636 |
| (206) | BioMarin Pharmaceutical Inc | Citibank | 1.108 | (1.741) | Brown & Brown Inc | BNP Paribas | 6.285 |
| (2.154) | BioMarin Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | 16.780 | (297) | Brown & Brown Inc | HSBC | 1.037 |
| (495) | BioMarin Pharmaceutical Inc | HSBC | 4.232 | (965) | Bunge Ltd | Barclays Bank | (2.268) |
| (263) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Barclays Bank | 3.144 | (815) | Bunge Ltd | BNP Paribas | (676) |
| (54) | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | BNP Paribas | 471 | (117) | Bunge Ltd | Citibank | (275) |
| | | | | (339) | Bunge Ltd | Goldman Sachs | (281) |
| | | | | (329) | Bunge Ltd | HSBC | (859) |
| | | | | (923) | Burlington Stores Inc | Barclays Bank | 11.936 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (58) | Burlington Stores Inc | HSBC | 1.806 | (607) | CDW Corp | BNP Paribas | (728) |
| 583 | Cadence Design Systems Inc | Barclays Bank | 9.910 | (479) | CDW Corp | Citibank | 1.485 |
| 3.915 | Cadence Design Systems Inc | Citibank | 85.345 | (108) | CDW Corp | Goldman Sachs | (130) |
| (910) | Caesars Entertainment Inc | Bank of America | | (52) | Centene Corp | Barclays Bank | 187 |
| (930) | Caesars Entertainment Inc | Merrill Lynch | 3.285 | (64) | Centene Corp | BNP Paribas | 359 |
| (523) | Caesars Entertainment Inc | Barclays Bank | 3.543 | (346) | Centene Corp | Goldman Sachs | 1.941 |
| (254) | Caesars Entertainment Inc | BNP Paribas | 1.888 | (438) | Centene Corp | HSBC | 2.926 |
| (1.467) | Caesars Entertainment Inc | Citibank | 968 | (165) | Ceridian HCM Holding Inc | Bank of America | |
| (583) | Caesars Entertainment Inc | Goldman Sachs | 5.296 | (1.455) | Ceridian HCM Holding Inc | Merrill Lynch | (302) |
| (576) | Caesars Entertainment Inc | HSBC | 2.589 | (1.842) | Ceridian HCM Holding Inc | Barclays Bank | 1.403 |
| (576) | Campbell Soup Co | Barclays Bank | 713 | (322) | Ceridian HCM Holding Inc | BNP Paribas | (3.371) |
| (617) | Campbell Soup Co | BNP Paribas | 1.817 | (599) | Ceridian HCM Holding Inc | Citibank | 602 |
| (304) | Campbell Soup Co | Barclays Bank | 324 | (1.233) | Ceridian HCM Holding Inc | Goldman Sachs | (1.096) |
| (1.744) | Campbell Soup Co | BNP Paribas | 5.136 | (872) | Ceridian HCM Holding Inc | HSBC | (3.576) |
| (124) | Capital One Financial Corp | Citibank | (606) | (380) | CF Industries Holdings Inc | Barclays Bank | 4.369 |
| (507) | Capital One Financial Corp | Goldman Sachs | (7.717) | (128) | CF Industries Holdings Inc | BNP Paribas | 1.999 |
| 560 | Cardinal Health Inc | Barclays Bank | (2.447) | 128 | CH Robinson Worldwide Inc | Bank of America | |
| 24 | Cardinal Health Inc | BNP Paribas | (95) | 1.165 | CH Robinson Worldwide Inc | Merrill Lynch | (550) |
| 485 | Cardinal Health Inc | Barclays Bank | (2.236) | 230 | CH Robinson Worldwide Inc | BNP Paribas | (5.010) |
| 847 | Cardinal Health Inc | BNP Paribas | (3.346) | (159) | CH Robinson Worldwide Inc | Goldman Sachs | (989) |
| 128 | Cardinal Health Inc | Citibank | (356) | (159) | Charles River Laboratories International Inc | Bank of America | |
| (47) | Carlisle Cos Inc | Goldman Sachs | (8) | (453) | Charles River Laboratories International Inc | Merrill Lynch | (229) |
| (204) | Carlisle Cos Inc | Barclays Bank | (20) | (379) | Charles River Laboratories International Inc | Barclays Bank | 3.416 |
| (48) | Carlisle Cos Inc | BNP Paribas | (8) | (40) | Charles River Laboratories International Inc | BNP Paribas | (546) |
| (61) | Carlisle Cos Inc | Citibank | (6) | (117) | Charles River Laboratories International Inc | Goldman Sachs | (168) |
| (46) | Carlisle Cos Inc | Goldman Sachs | (75) | (126) | Charles River Laboratories International Inc | HSBC | (494) |
| 195 | Carlyle Group Inc | HSBC | | (63) | Charles River Laboratories International Inc | JP Morgan | (247) |
| 886 | Carlyle Group Inc | Bank of America | 181 | (398) | Charles Schwab Corp | Bank of America | |
| 92 | Carlyle Group Inc | Merrill Lynch | (159) | (1.625) | Charles Schwab Corp | Merrill Lynch | (872) |
| 170 | Carlyle Group Inc | Barclays Bank | 86 | (1.060) | Charles Schwab Corp | Barclays Bank | (1.885) |
| (2.902) | CarMax Inc | Goldman Sachs | 270 | (2.650) | Charles Schwab Corp | BNP Paribas | (2.321) |
| (1.117) | CarMax Inc | Barclays Bank | — | (48) | Charles Schwab Corp | Goldman Sachs | (5.804) |
| (1.255) | CarMax Inc | BNP Paribas | (570) | (109) | Charles Schwab Corp | HSBC | (264) |
| (9.060) | CarMax Inc | Goldman Sachs | (640) | (160) | Charter Communications Inc 'A' | Barclays Bank | 1.203 |
| (12.212) | Carnival Corp | Barclays Bank | (906) | (44) | Charter Communications Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.046 |
| (8.081) | Carnival Corp | BNP Paribas | (12.334) | (163) | Charter Communications Inc 'A' | HSBC | 882 |
| (8.081) | Carnival Corp | Goldman Sachs | (8.162) | 163 | Check Point Software Technologies Ltd | BNP Paribas | 645 |
| 294 | Carrier Global Corp | Bank of America | | 301 | Check Point Software Technologies Ltd | Citibank | 424 |
| 254 | Carrier Global Corp | Merrill Lynch | (517) | 91 | Check Point Software Technologies Ltd | HSBC | 144 |
| 1.069 | Carrier Global Corp | Barclays Bank | (351) | 98 | Check Point Software Technologies Ltd | JP Morgan | 155 |
| 268 | Carrier Global Corp | BNP Paribas | (1.881) | (104) | Cheniere Energy Inc | Bank of America | |
| 264 | Carrier Global Corp | Citibank | (370) | (129) | Cheniere Energy Inc | Merrill Lynch | 1.344 |
| (1.612) | Catalent Inc | HSBC | (409) | (125) | Cheniere Energy Inc | Citibank | 909 |
| (810) | Catalent Inc | Bank of America | (5.239) | (60) | Cheniere Energy Inc | Goldman Sachs | 1.615 |
| (1.129) | Catalent Inc | Merrill Lynch | 867 | (129) | Cheniere Energy Corp | HSBC | 763 |
| (1.303) | Catalent Inc | Barclays Bank | (3.669) | (129) | Chesapeake Energy Corp | Bank of America | |
| (484) | Catalent Inc | BNP Paribas | 318 | (913) | Chesapeake Energy Corp | Merrill Lynch | 799 |
| (236) | Catalent Inc | Citibank | (1.573) | (746) | Chesapeake Energy Corp | Barclays Bank | 5.478 |
| 32 | Caterpillar Inc | Goldman Sachs | (231) | (388) | Chesapeake Energy Corp | BNP Paribas | 4.618 |
| 226 | Caterpillar Inc | HSBC | (132) | (157) | Chesapeake Energy Corp | Citibank | 1.514 |
| 141 | Caterpillar Inc | Bank of America | (1.106) | (123) | Chevron Corp | HSBC | 393 |
| 410 | Caterpillar Inc | Merrill Lynch | (584) | (9) | Chevron Corp | Bank of America | |
| (90) | Cboe Global Markets Inc | Barclays Bank | (2.193) | (103) | Chevron Corp | Merrill Lynch | 641 |
| (115) | Cboe Global Markets Inc | BNP Paribas | 610 | (221) | Chevron Corp | BNP Paribas | 47 |
| (229) | Cboe Global Markets Inc | Citibank | 810 | | | Goldman Sachs | 537 |
| (574) | CBRE Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.553 | | | HSBC | 1.677 |
| (129) | CBRE Group Inc 'A' | Bank of America | (321) | | | | |
| (644) | CBRE Group Inc 'A' | Merrill Lynch | 431 | | | | |
| (757) | CBRE Group Inc 'A' | Barclays Bank | (361) | | | | |
| (240) | CBRE Group Inc 'A' | BNP Paribas | 216 | | | | |
| (417) | CBRE Group Inc 'A' | Citibank | (134) | | | | |
| (84) | CDW Corp | Goldman Sachs | (659) | | | | |
| | | HSBC | (101) | | | | |
| | | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (622) | Chewy Inc 'A' | Bank of America | | 515 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.811 | | | Merrill Lynch | (2.220) |
| (518) | Chewy Inc 'A' | Barclays Bank | 1.228 | 2.173 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Barclays Bank | (4.360) |
| (162) | Chewy Inc 'A' | BNP Paribas | 732 | | | | |
| 32 | Chipotle Mexican Grill Inc | BNP Paribas | 641 | 704 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | BNP Paribas | (3.034) |
| 48 | Chipotle Mexican Grill Inc | Goldman Sachs | 961 | | | | |
| (1.394) | Church & Dwight Co Inc | Barclays Bank | 4.544 | 664 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Citibank | (1.569) |
| (2.274) | Church & Dwight Co Inc | Goldman Sachs | 10.438 | | | | |
| 216 | Cigna Group | Bank of America | | 997 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Goldman Sachs | (4.297) |
| | | Merrill Lynch | (3.108) | | | | |
| 315 | Cigna Group | Barclays Bank | (3.000) | 631 | Coca-Cola Europacific Partners Plc | HSBC | (2.196) |
| 61 | Cigna Group | BNP Paribas | (878) | | | | |
| 262 | Cigna Group | Citibank | (765) | (253) | Cognex Corp | Bank of America | |
| 219 | Cigna Group | Goldman Sachs | (3.151) | | | Merrill Lynch | (918) |
| 27 | Cigna Group | HSBC | (569) | (240) | Cognex Corp | Barclays Bank | (497) |
| (190) | Cincinnati Financial Corp | Barclays Bank | 1.250 | (328) | Cognex Corp | HSBC | (1.706) |
| (392) | Cincinnati Financial Corp | BNP Paribas | 2.415 | (520) | Cognex Corp | JP Morgan | (2.704) |
| (751) | Cincinnati Financial Corp | HSBC | 6.121 | 2.422 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | BNP Paribas | (424) |
| 201 | Cintas Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 88 | 777 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Goldman Sachs | (136) |
| 634 | Cintas Corp | Barclays Bank | (1.344) | | | | |
| 419 | Cintas Corp | BNP Paribas | 184 | (56) | Coinbase Global Inc 'A' | Bank of America | |
| 135 | Cintas Corp | Citibank | (286) | | | Merrill Lynch | (57) |
| 209 | Cintas Corp | Goldman Sachs | 92 | (620) | Coinbase Global Inc 'A' | Barclays Bank | (446) |
| 82 | Cintas Corp | HSBC | 759 | (373) | Coinbase Global Inc 'A' | BNP Paribas | (380) |
| 47 | Cintas Corp | JP Morgan | 435 | (1.722) | Colgate-Palmolive Co | Barclays Bank | 5.464 |
| 587 | Cisco Systems Inc | Barclays Bank | 495 | (258) | Colgate-Palmolive Co | Citibank | 439 |
| 42 | Citigroup Inc | Bank of America | | 490 | Comcast Corp 'A' | Barclays Bank | (990) |
| | | Merrill Lynch | (84) | 295 | Comcast Corp 'A' | BNP Paribas | (289) |
| 2.474 | Citigroup Inc | Barclays Bank | (2.136) | 1.902 | Comcast Corp 'A' | Goldman Sachs | (1.864) |
| 5.663 | Citigroup Inc | BNP Paribas | (11.326) | (1.042) | Conagra Brands Inc | Bank of America | |
| 383 | Citigroup Inc | Goldman Sachs | (766) | | | Merrill Lynch | 2.105 |
| 51 | Citigroup Inc | HSBC | (118) | (514) | Conagra Brands Inc | BNP Paribas | 1.038 |
| (1.727) | Citizens Financial Group Inc | Bank of America | | (472) | Conagra Brands Inc | Goldman Sachs | 953 |
| | | Merrill Lynch | (1.243) | 113 | ConocoPhillips | Bank of America | |
| (529) | Citizens Financial Group Inc | Barclays Bank | 370 | | | Merrill Lynch | 5 |
| (328) | Citizens Financial Group Inc | BNP Paribas | (236) | 364 | ConocoPhillips | Barclays Bank | (1.238) |
| (427) | Citizens Financial Group Inc | Citibank | 299 | 511 | ConocoPhillips | BNP Paribas | 20 |
| (403) | Citizens Financial Group Inc | Goldman Sachs | (290) | 128 | ConocoPhillips | Citibank | (112) |
| (1.669) | Clarivate Plc | BNP Paribas | 893 | 687 | ConocoPhillips | Goldman Sachs | 27 |
| (6.866) | Clarivate Plc | Goldman Sachs | 3.673 | 13 | ConocoPhillips | HSBC | (7) |
| (880) | Cleveland-Cliffs Inc | Bank of America | | (14.613) | ConocoPhillips | JP Morgan | 8.329 |
| | | Merrill Lynch | 986 | (682) | Consolidated Edison Inc | Barclays Bank | 1.391 |
| (578) | Cleveland-Cliffs Inc | Barclays Bank | 601 | (13) | Constellation Brands Inc 'A' | Bank of America | |
| (2.853) | Cleveland-Cliffs Inc | BNP Paribas | 3.195 | | | Merrill Lynch | (98) |
| (1.958) | Cleveland-Cliffs Inc | Goldman Sachs | 2.193 | (365) | Constellation Brands Inc 'A' | Barclays Bank | (891) |
| (715) | Clorox Co | Goldman Sachs | 7.064 | (55) | Constellation Brands Inc 'A' | HSBC | (534) |
| (268) | Cloudflare Inc 'A' | Bank of America | | (164) | Constellation Energy Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (4.368) | | | Merrill Lynch | (531) |
| (742) | Cloudflare Inc 'A' | Barclays Bank | (7.947) | (420) | Constellation Energy Corp | Barclays Bank | 50 |
| (1.288) | Cloudflare Inc 'A' | BNP Paribas | (20.994) | (468) | Constellation Energy Corp | BNP Paribas | (1.516) |
| (188) | Cloudflare Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.064) | (304) | Constellation Energy Corp | Citibank | 35 |
| (498) | Cloudflare Inc 'A' | HSBC | (10.558) | (267) | Constellation Energy Corp | Goldman Sachs | (865) |
| (493) | CME Group Inc | Barclays Bank | 1.518 | (538) | Constellation Energy Corp | HSBC | (2.582) |
| (298) | CME Group Inc | BNP Paribas | 1.952 | (39) | Cooper Cos Inc | Bank of America | |
| (481) | CME Group Inc | Citibank | 1.250 | | | Merrill Lynch | 849 |
| (206) | CME Group Inc | Goldman Sachs | 1.349 | (91) | Cooper Cos Inc | Barclays Bank | 2.053 |
| (100) | CME Group Inc | HSBC | 787 | (575) | Cooper Cos Inc | BNP Paribas | 12.518 |
| (847) | CMS Energy Corp | Barclays Bank | 1.063 | (228) | Cooper Cos Inc | Citibank | 1.772 |
| (1.310) | CMS Energy Corp | BNP Paribas | 4.598 | (187) | Cooper Cos Inc | Goldman Sachs | 4.071 |
| (194) | CMS Energy Corp | Citibank | (27) | (30) | Cooper Cos Inc | HSBC | 556 |
| (297) | CMS Energy Corp | Goldman Sachs | 1.042 | 386 | Copart Inc | Bank of America | |
| 341 | Coca-Cola Co | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 2.455 |
| | | Merrill Lynch | (1.538) | 2.630 | Copart Inc | Barclays Bank | (3.103) |
| 4.191 | Coca-Cola Co | Barclays Bank | (7.274) | 2.051 | Copart Inc | BNP Paribas | 13.044 |
| 2.606 | Coca-Cola Co | BNP Paribas | (11.753) | 2.231 | Copart Inc | Goldman Sachs | 14.189 |
| 1.547 | Coca-Cola Co | Citibank | (2.523) | 1.196 | Copart Inc | HSBC | 10.238 |
| 633 | Coca-Cola Co | Goldman Sachs | (2.855) | 403 | Copart Inc | JP Morgan | 3.450 |
| 1.572 | Coca-Cola Co | HSBC | (7.058) | (268) | Corning Inc | Barclays Bank | 225 |
| 408 | Coca-Cola Co | JP Morgan | (1.832) | (528) | Corning Inc | Citibank | 444 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (287) | Corning Inc | Goldman Sachs | 155 | 291 | Darden Restaurants Inc | HSBC | 2.654 |
| (291) | Corning Inc | HSBC | 236 | 5 | Darden Restaurants Inc | JP Morgan | 46 |
| (228) | Corteva Inc | Barclays Bank | 258 | (321) | Darling Ingredients Inc | Bank of America | |
| (373) | Corteva Inc | BNP Paribas | 1.518 | | | Merrill Lynch | 205 |
| (208) | Corteva Inc | Citibank | 277 | (837) | Darling Ingredients Inc | Barclays Bank | 2.026 |
| (178) | CoStar Group Inc | Bank of America | | (2.783) | Darling Ingredients Inc | BNP Paribas | 1.781 |
| | | Merrill Lynch | (562) | (155) | Darling Ingredients Inc | Citibank | 375 |
| (568) | CoStar Group Inc | Barclays Bank | (575) | (1.213) | Darling Ingredients Inc | Goldman Sachs | 776 |
| (404) | CoStar Group Inc | BNP Paribas | (1.277) | (714) | Darling Ingredients Inc | HSBC | (3.306) |
| (173) | CoStar Group Inc | Citibank | (86) | (243) | Datadog Inc 'A' | Bank of America | |
| (40) | CoStar Group Inc | Goldman Sachs | (126) | | | Merrill Lynch | (1.561) |
| (163) | CoStar Group Inc | HSBC | (789) | (1.449) | Datadog Inc 'A' | Barclays Bank | (1.529) |
| (25) | Costco Wholesale Corp | Bank of America | | (24) | Datadog Inc 'A' | BNP Paribas | (154) |
| | | Merrill Lynch | (99) | (172) | Datadog Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.105) |
| (84) | Costco Wholesale Corp | Barclays Bank | (862) | (314) | DaVita Inc | Bank of America | |
| (70) | Costco Wholesale Corp | BNP Paribas | (276) | | | Merrill Lynch | 970 |
| (26) | Costco Wholesale Corp | Citibank | (367) | (322) | DaVita Inc | Barclays Bank | 1.942 |
| (51) | Costco Wholesale Corp | Goldman Sachs | (201) | (946) | DaVita Inc | BNP Paribas | 2.923 |
| (33) | Costco Wholesale Corp | JP Morgan | (228) | (35) | DaVita Inc | Citibank | 211 |
| (898) | Coterra Energy Inc | Bank of America | | (698) | DaVita Inc | Goldman Sachs | 2.157 |
| | | Merrill Lynch | 1.931 | (489) | DaVita Inc | HSBC | (2.230) |
| (2.664) | Coterra Energy Inc | Barclays Bank | 6.607 | (8) | Deere & Co | Bank of America | |
| (2.594) | Coterra Energy Inc | BNP Paribas | 5.577 | | | Merrill Lynch | 175 |
| (2.238) | Coterra Energy Inc | HSBC | 3.245 | (280) | Deere & Co | Barclays Bank | 3.394 |
| (853) | Coterra Energy Inc | JP Morgan | 1.237 | (304) | Deere & Co | BNP Paribas | 6.636 |
| (507) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Bank of America | | (30) | Deere & Co | Citibank | 364 |
| | | Merrill Lynch | (12.553) | (42) | Deere & Co | HSBC | 1.339 |
| (223) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Barclays Bank | (2.877) | 553 | Dell Technologies Inc 'C' | Bank of America | |
| (89) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.204) | | | Merrill Lynch | 608 |
| (184) | Crowdstrike Holdings Inc 'A' | HSBC | (5.134) | 332 | Dell Technologies Inc 'C' | Barclays Bank | (501) |
| (1.144) | Crown Holdings Inc | Barclays Bank | 4.051 | 1.901 | Dell Technologies Inc 'C' | BNP Paribas | 2.091 |
| (367) | Crown Holdings Inc | BNP Paribas | 2.261 | 773 | Dell Technologies Inc 'C' | Citibank | (1.167) |
| (1.311) | Crown Holdings Inc | Goldman Sachs | 8.076 | 234 | Dell Technologies Inc 'C' | Goldman Sachs | 257 |
| (84) | Crown Holdings Inc | HSBC | 647 | 234 | Dell Technologies Inc 'C' | HSBC | 2 |
| 1.343 | CSX Corp | Bank of America | | 15 | Delta Air Lines Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.706) | | | Merrill Lynch | 39 |
| 1.912 | CSX Corp | Barclays Bank | (2.218) | 468 | Delta Air Lines Inc | Barclays Bank | 412 |
| 4.857 | CSX Corp | BNP Paribas | (6.168) | 905 | Delta Air Lines Inc | BNP Paribas | 2.371 |
| 678 | CSX Corp | Citibank | (786) | 833 | Delta Air Lines Inc | Goldman Sachs | 2.182 |
| 2.019 | CSX Corp | Goldman Sachs | (2.564) | 289 | Delta Air Lines Inc | HSBC | 618 |
| 1.819 | CSX Corp | HSBC | (2.074) | 1.890 | DENTSPLY SIRONA Inc | Barclays Bank | (5.649) |
| 579 | CSX Corp | JP Morgan | (660) | 892 | DENTSPLY SIRONA Inc | Citibank | (3.095) |
| 140 | Cummins Inc | Bank of America | | (1.009) | Devon Energy Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (2.038) | | | Merrill Lynch | 1.382 |
| 505 | Cummins Inc | Barclays Bank | (6.115) | (430) | Devon Energy Corp | Citibank | 1.281 |
| 1.159 | Cummins Inc | BNP Paribas | (16.875) | 220 | Dexcom Inc | Barclays Bank | (547) |
| 49 | Cummins Inc | Citibank | (678) | 113 | Dexcom Inc | BNP Paribas | (588) |
| 355 | Cummins Inc | Goldman Sachs | (5.169) | 174 | Dexcom Inc | Goldman Sachs | (905) |
| 72 | Cummins Inc | HSBC | (1.408) | 92 | Dexcom Inc | JP Morgan | (531) |
| 148 | Cummins Inc | JP Morgan | (2.893) | 299 | Diamondback Energy Inc | Barclays Bank | (1.606) |
| 2.868 | CVS Health Corp | Barclays Bank | (4.835) | 396 | Diamondback Energy Inc | BNP Paribas | (744) |
| 968 | CVS Health Corp | BNP Paribas | (1.810) | 588 | Diamondback Energy Inc | Goldman Sachs | (1.105) |
| 1.203 | CVS Health Corp | Citibank | (2.068) | 185 | Diamondback Energy Inc | HSBC | (1.019) |
| 1.474 | CVS Health Corp | Goldman Sachs | (2.756) | 81 | Discover Financial Services | Bank of America | |
| 1.094 | CVS Health Corp | HSBC | (2.954) | | | Merrill Lynch | 496 |
| 103 | CVS Health Corp | JP Morgan | (278) | 1.135 | Discover Financial Services | Barclays Bank | 2.383 |
| (418) | CyberArk Software Ltd | Bank of America | | 440 | Discover Financial Services | BNP Paribas | 2.693 |
| | | Merrill Lynch | (3.469) | 356 | Discover Financial Services | Goldman Sachs | 2.179 |
| (114) | CyberArk Software Ltd | Goldman Sachs | (946) | 351 | Discover Financial Services | HSBC | 2.218 |
| (100) | CyberArk Software Ltd | HSBC | (1.510) | 112 | Discover Financial Services | JP Morgan | 708 |
| (84) | Danaher Corp | Barclays Bank | 550 | (1.404) | DISH Network Corp 'A' | Bank of America | |
| (169) | Danaher Corp | BNP Paribas | 373 | | | Merrill Lynch | (49) |
| (22) | Danaher Corp | Goldman Sachs | 49 | (11.112) | DISH Network Corp 'A' | Barclays Bank | 1.540 |
| (203) | Danaher Corp | HSBC | 2.946 | (7.459) | DISH Network Corp 'A' | BNP Paribas | (261) |
| 324 | Darden Restaurants Inc | Bank of America | | (1.207) | DISH Network Corp 'A' | Citibank | 211 |
| | | Merrill Lynch | 2.420 | (2.392) | DISH Network Corp 'A' | HSBC | 1.591 |
| 471 | Darden Restaurants Inc | Barclays Bank | (881) | 655 | DocuSign Inc | Bank of America | |
| 618 | Darden Restaurants Inc | BNP Paribas | 4.616 | | | Merrill Lynch | 3.209 |
| 70 | Darden Restaurants Inc | Citibank | (131) | 93 | DocuSign Inc | Barclays Bank | 51 |
| 341 | Darden Restaurants Inc | Goldman Sachs | 2.547 | 1.414 | DocuSign Inc | BNP Paribas | 6.929 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------|-----------------|---|---|--------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 470 | DocuSign Inc | Goldman Sachs | 2.303 | (2.016) | Elanco Animal Health Inc | Bank of America | |
| 240 | DocuSign Inc | HSBC | 1.608 | | | Merrill Lynch | 1.794 |
| 228 | DocuSign Inc | JP Morgan | 1.528 | (13.735) | Elanco Animal Health Inc | Barclays Bank | 12.224 |
| (297) | Dollar General Corp | Bank of America | | (2.535) | Elanco Animal Health Inc | BNP Paribas | 2.256 |
| | | Merrill Lynch | 4.681 | (1.691) | Elanco Animal Health Inc | Citibank | 1.505 |
| (140) | Dollar General Corp | Barclays Bank | 1.343 | (4.948) | Elanco Animal Health Inc | Goldman Sachs | 4.404 |
| (844) | Dollar General Corp | BNP Paribas | 13.301 | (923) | Elanco Animal Health Inc | JP Morgan | 1.246 |
| (274) | Dollar General Corp | Goldman Sachs | 4.318 | 281 | Electronic Arts Inc | Barclays Bank | 6 |
| (219) | Dollar Tree Inc | Barclays Bank | 4.923 | (27) | Elevance Health Inc | Barclays Bank | (17) |
| (507) | Dollar Tree Inc | BNP Paribas | 10.966 | (40) | Elevance Health Inc | BNP Paribas | 318 |
| (353) | Dollar Tree Inc | Citibank | 4.970 | (77) | Elevance Health Inc | Citibank | 634 |
| (904) | Dollar Tree Inc | Goldman Sachs | 19.554 | (144) | Elevance Health Inc | Goldman Sachs | 1.143 |
| (23) | Dollar Tree Inc | HSBC | 414 | (64) | Elevance Health Inc | HSBC | 1.317 |
| 129 | Domino's Pizza Inc | Bank of America | | (27) | Eli Lilly & Co | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (2.052) | | | Merrill Lynch | 265 |
| 180 | Domino's Pizza Inc | BNP Paribas | (2.864) | (2) | Eli Lilly & Co | BNP Paribas | 20 |
| 40 | Domino's Pizza Inc | Goldman Sachs | (636) | (144) | Eli Lilly & Co | Goldman Sachs | 1.411 |
| 48 | Domino's Pizza Inc | HSBC | (816) | (188) | Emerson Electric Co | Bank of America | |
| 52 | Domino's Pizza Inc | JP Morgan | (884) | | | Merrill Lynch | 1.132 |
| (325) | DoorDash Inc 'A' | Barclays Bank | 352 | (29) | Emerson Electric Co | Citibank | 134 |
| (124) | DoorDash Inc 'A' | Citibank | 174 | (194) | Emerson Electric Co | Goldman Sachs | 1.168 |
| 222 | Dover Corp | Barclays Bank | (1.168) | (47) | Enphase Energy Inc | Bank of America | |
| (711) | Dow Inc | Goldman Sachs | 2.510 | | | Merrill Lynch | (231) |
| 692 | DR Horton Inc | Bank of America | | (135) | Enphase Energy Inc | BNP Paribas | (664) |
| | | Merrill Lynch | (2.062) | (65) | Enphase Energy Inc | Goldman Sachs | (320) |
| 271 | DR Horton Inc | Barclays Bank | 49 | (158) | Enphase Energy Inc | HSBC | (1.634) |
| 335 | DR Horton Inc | Citibank | (54) | (285) | Entegris Inc | Bank of America | |
| 6.486 | Dropbox Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (4.398) |
| | | Merrill Lynch | 1.751 | (1.617) | Entegris Inc | Barclays Bank | (16.720) |
| 8.702 | Dropbox Inc 'A' | Barclays Bank | 2.967 | (1.354) | Entegris Inc | Citibank | (14.000) |
| 21.955 | Dropbox Inc 'A' | BNP Paribas | 5.928 | (3.218) | Entegris Inc | Goldman Sachs | (49.654) |
| 453 | Dropbox Inc 'A' | Citibank | 201 | (31) | Entegris Inc | JP Morgan | (856) |
| 16.171 | Dropbox Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.366 | 695 | EOG Resources Inc | Bank of America | |
| 4.391 | Dropbox Inc 'A' | HSBC | 6.411 | | | Merrill Lynch | (2.655) |
| 2.579 | Dropbox Inc 'A' | JP Morgan | 3.765 | 502 | EOG Resources Inc | Barclays Bank | (3.027) |
| 5.949 | DuPont de Nemours Inc | Bank of America | | 631 | EOG Resources Inc | BNP Paribas | (2.410) |
| | | Merrill Lynch | 12.255 | 194 | EOG Resources Inc | Citibank | (1.170) |
| 637 | DuPont de Nemours Inc | BNP Paribas | 1.312 | 918 | EOG Resources Inc | Goldman Sachs | (3.507) |
| 204 | Dynatrace Inc | Barclays Bank | 215 | 111 | EOG Resources Inc | HSBC | (759) |
| 534 | Eaton Corp Plc | Barclays Bank | 2.526 | 71 | EOG Resources Inc | JP Morgan | (486) |
| 225 | Eaton Corp Plc | BNP Paribas | 2.023 | (43) | EPAM Systems Inc | Barclays Bank | 302 |
| 369 | Eaton Corp Plc | Goldman Sachs | 3.317 | (40) | EPAM Systems Inc | Citibank | (7) |
| 72 | Eaton Corp Plc | HSBC | 650 | (949) | EQT Corp | Barclays Bank | 1.158 |
| 349 | Eaton Corp Plc | JP Morgan | 3.151 | (656) | EQT Corp | BNP Paribas | 33 |
| 550 | eBay Inc | Bank of America | | (351) | EQT Corp | Citibank | 428 |
| | | Merrill Lynch | (1.320) | (628) | EQT Corp | Goldman Sachs | 31 |
| 6.715 | eBay Inc | Barclays Bank | (9.334) | (771) | EQT Corp | HSBC | (2.159) |
| 9.228 | eBay Inc | BNP Paribas | (22.147) | (70) | Equifax Inc | Bank of America | |
| 1.059 | eBay Inc | Citibank | (1.472) | | | Merrill Lynch | (229) |
| 5.707 | eBay Inc | Goldman Sachs | (13.697) | (80) | Equifax Inc | Barclays Bank | 518 |
| 2.381 | eBay Inc | HSBC | (8.286) | (190) | Equifax Inc | BNP Paribas | (621) |
| 745 | eBay Inc | JP Morgan | (2.593) | (103) | Equifax Inc | Goldman Sachs | (337) |
| (65) | Ecolab Inc | Bank of America | | 1.739 | Equitable Holdings Inc | BNP Paribas | 1.443 |
| | | Merrill Lynch | 613 | 386 | Equitable Holdings Inc | Goldman Sachs | 320 |
| (120) | Ecolab Inc | BNP Paribas | 1.132 | 296 | Equitable Holdings Inc | HSBC | 355 |
| (197) | Ecolab Inc | Citibank | 1.708 | (407) | Erie Indemnity Co 'A' | Bank of America | |
| 440 | Edison International | Barclays Bank | (559) | | | Merrill Lynch | 5.087 |
| 1.012 | Edison International | BNP Paribas | (5.900) | (570) | Erie Indemnity Co 'A' | Barclays Bank | 5.746 |
| 821 | Edison International | Goldman Sachs | (4.786) | (218) | Erie Indemnity Co 'A' | Goldman Sachs | 2.725 |
| 324 | Edison International | HSBC | (2.262) | (2.486) | Essential Utilities Inc | Bank of America | |
| 383 | Edison International | JP Morgan | (2.673) | | | Merrill Lynch | 3.903 |
| 211 | Edwards Lifesciences Corp | Bank of America | | (1.451) | Essential Utilities Inc | Barclays Bank | 116 |
| | | Merrill Lynch | (1.559) | (1.487) | Essential Utilities Inc | BNP Paribas | 2.335 |
| 3.073 | Edwards Lifesciences Corp | Barclays Bank | (23.447) | (812) | Essential Utilities Inc | Citibank | 65 |
| 3.020 | Edwards Lifesciences Corp | BNP Paribas | (22.318) | (873) | Essential Utilities Inc | Goldman Sachs | 1.371 |
| 414 | Edwards Lifesciences Corp | Citibank | 11 | (215) | Essential Utilities Inc | HSBC | 516 |
| 1.714 | Edwards Lifesciences Corp | Goldman Sachs | (12.666) | (83) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Barclays Bank | 481 |
| 439 | Edwards Lifesciences Corp | HSBC | (3.288) | (72) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Citibank | 854 |
| 158 | Edwards Lifesciences Corp | JP Morgan | (1.183) | 94 | Etsy Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (1.440) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 618 | Etsy Inc | Barclays Bank | (4.629) | (858) | Fifth Third Bancorp | Bank of America | (626) |
| 466 | Etsy Inc | BNP Paribas | (7.139) | | | Merrill Lynch | 200 |
| 235 | Etsy Inc | Citibank | 8 | (400) | Fifth Third Bancorp | Barclays Bank | 200 |
| 261 | Etsy Inc | HSBC | (2.675) | (841) | Fifth Third Bancorp | BNP Paribas | (614) |
| 226 | Etsy Inc | JP Morgan | (2.317) | (568) | Fifth Third Bancorp | Citibank | 284 |
| 60 | Everest Re Group Ltd | Bank of America | | (431) | Fifth Third Bancorp | Goldman Sachs | (315) |
| | | Merrill Lynch | (1.968) | (1.236) | Fifth Third Bancorp | HSBC | (667) |
| 28 | Everest Re Group Ltd | Barclays Bank | (309) | (10) | First Citizens | Bank of America | |
| 82 | Everest Re Group Ltd | Goldman Sachs | (2.690) | | BancShares Inc 'A' | Merrill Lynch | 39 |
| 29 | Everest Re Group Ltd | HSBC | (950) | (29) | First Citizens | | |
| 28 | Everest Re Group Ltd | JP Morgan | (918) | | BancShares Inc 'A' | Barclays Bank | 1.298 |
| (331) | Eversource Energy | Barclays Bank | 719 | (181) | First Citizens | | |
| (446) | Eversource Energy | BNP Paribas | 3.795 | | BancShares Inc 'A' | BNP Paribas | 699 |
| (704) | Eversource Energy | Citibank | 2.274 | (28) | First Citizens | | |
| (1.083) | Exact Sciences Corp | Barclays Bank | 3.855 | | BancShares Inc 'A' | HSBC | (4.813) |
| 3.534 | Exelon Corp | Barclays Bank | (3.163) | (591) | First Solar Inc | Bank of America | |
| 122 | Exelon Corp | BNP Paribas | (187) | | | Merrill Lynch | 11.867 |
| 1.885 | Exelon Corp | Goldman Sachs | (2.893) | (693) | First Solar Inc | Barclays Bank | 125 |
| 951 | Exelon Corp | HSBC | (3.371) | (197) | First Solar Inc | Citibank | 76 |
| 41 | Exelon Corp | JP Morgan | (145) | (1.095) | Fiserv Inc | Barclays Bank | 9.307 |
| 476 | Expedia Group Inc | Bank of America | | (137) | FleetCor Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.109 | | | Merrill Lynch | 493 |
| 2.055 | Expedia Group Inc | Barclays Bank | (4.591) | (209) | FleetCor Technologies Inc | Barclays Bank | 1.331 |
| 289 | Expedia Group Inc | BNP Paribas | 673 | (221) | FleetCor Technologies Inc | Goldman Sachs | 796 |
| 803 | Expedia Group Inc | Citibank | (1.049) | (106) | FleetCor Technologies Inc | HSBC | 347 |
| 1.023 | Expedia Group Inc | Goldman Sachs | 2.384 | 253 | FMC Corp | Barclays Bank | (1.083) |
| 40 | Expedia Group Inc | HSBC | 83 | (811) | Ford Motor Co | Barclays Bank | (511) |
| 173 | Expeditors International of Washington Inc | | | (4.866) | Ford Motor Co | BNP Paribas | (3.017) |
| | | Barclays Bank | (757) | (3.880) | Ford Motor Co | Goldman Sachs | (2.406) |
| 1.306 | Expeditors International of Washington Inc | BNP Paribas | (2.560) | 1.499 | Fortinet Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 135 |
| 1.791 | Expeditors International of Washington Inc | | | 2.005 | Fortinet Inc | BNP Paribas | 180 |
| | | Goldman Sachs | (3.510) | 561 | Fortinet Inc | Citibank | 173 |
| 1.282 | Expeditors International of Washington Inc | JP Morgan | (7.461) | 52 | Fortinet Inc | Goldman Sachs | 5 |
| | | | | 393 | Fortinet Inc | HSBC | 1.010 |
| 424 | Exxon Mobil Corp | Barclays Bank | (1.407) | 607 | Fortive Corp | Bank of America | |
| 106 | Exxon Mobil Corp | Citibank | (251) | | | Merrill Lynch | 231 |
| 213 | Exxon Mobil Corp | Goldman Sachs | (526) | 175 | Fortive Corp | Barclays Bank | (65) |
| 104 | Exxon Mobil Corp | JP Morgan | (677) | 150 | Fortive Corp | Citibank | (56) |
| 169 | F5 Inc | Bank of America | | 146 | Fortive Corp | JP Morgan | 183 |
| | | Merrill Lynch | 1.406 | 967 | Fortune Brands | | |
| 332 | F5 Inc | Barclays Bank | 1.165 | | Innovations Inc | Barclays Bank | (1.713) |
| 91 | F5 Inc | BNP Paribas | 757 | 1.929 | Fortune Brands | | |
| 79 | F5 Inc | Citibank | 277 | | Innovations Inc | BNP Paribas | (9.568) |
| 69 | F5 Inc | JP Morgan | 912 | 529 | Fortune Brands | | |
| 17 | Fair Isaac Corp | Bank of America | | | Innovations Inc | Citibank | (447) |
| | | Merrill Lynch | 602 | 394 | Fortune Brands | | |
| 34 | Fair Isaac Corp | Barclays Bank | 39 | | Innovations Inc | Goldman Sachs | (1.954) |
| 18 | Fair Isaac Corp | BNP Paribas | 638 | 326 | Fortune Brands | | |
| 225 | Fair Isaac Corp | Goldman Sachs | 7.972 | | Innovations Inc | HSBC | (1.676) |
| 17 | Fair Isaac Corp | JP Morgan | 938 | 200 | Fortune Brands | | |
| 332 | Fastenal Co | BNP Paribas | (37) | | Innovations Inc | JP Morgan | (1.028) |
| 527 | Fastenal Co | Citibank | (514) | 5.603 | Franklin Resources Inc | Barclays Bank | (2.970) |
| 490 | Fastenal Co | JP Morgan | (113) | 613 | Franklin Resources Inc | BNP Paribas | (264) |
| 73 | FedEx Corp | Bank of America | | 654 | Franklin Resources Inc | Goldman Sachs | (281) |
| | | Merrill Lynch | (192) | (876) | Freeport-McMoRan Inc | Barclays Bank | 1.813 |
| 306 | FedEx Corp | Barclays Bank | (2.720) | 483 | Garmin Ltd | BNP Paribas | 657 |
| 146 | FedEx Corp | Goldman Sachs | (384) | 827 | Garmin Ltd | Goldman Sachs | 1.125 |
| 5 | FedEx Corp | HSBC | (55) | (125) | Gartner Inc | Barclays Bank | (1.620) |
| 350 | Ferguson Plc | Barclays Bank | (9) | (239) | GE Healthcare Inc | Bank of America | |
| 95 | Ferguson Plc | BNP Paribas | (143) | | | Merrill Lynch | (975) |
| 99 | Ferguson Plc | Citibank | (61) | (201) | GE Healthcare Inc | Barclays Bank | 14 |
| 75 | Ferguson Plc | JP Morgan | 384 | (545) | GE Healthcare Inc | BNP Paribas | (2.224) |
| (490) | Fidelity National Information Services Inc | Bank of America | | (291) | GE Healthcare Inc | Goldman Sachs | (1.187) |
| | | Merrill Lynch | 911 | (2.546) | Gen Digital Inc | Bank of America | |
| (1.623) | Fidelity National Information Services Inc | | | | | Merrill Lynch | (2.610) |
| | | Barclays Bank | 6.167 | (11.767) | Gen Digital Inc | Barclays Bank | (4.259) |
| (226) | Fidelity National Information Services Inc | BNP Paribas | 420 | (9.806) | Gen Digital Inc | BNP Paribas | (10.051) |
| | | | | (4.523) | Gen Digital Inc | Citibank | (1.696) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (3.451) | Gen Digital Inc | Goldman Sachs | (3.537) | (350) | Hasbro Inc | Goldman Sachs | 931 |
| (2.626) | Gen Digital Inc | HSBC | (1.011) | (885) | Hasbro Inc | HSBC | (204) |
| (104) | Generac Holdings Inc | Bank of America | | 407 | HCA Healthcare Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 553 | | | Merrill Lynch | (6.732) |
| (173) | Generac Holdings Inc | BNP Paribas | 920 | 294 | HCA Healthcare Inc | Barclays Bank | (4.722) |
| (326) | Generac Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.734 | 172 | HCA Healthcare Inc | BNP Paribas | (2.845) |
| (110) | Generac Holdings Inc | HSBC | (98) | 153 | HCA Healthcare Inc | Citibank | (1.091) |
| (289) | General Electric Co | Barclays Bank | 1.107 | 57 | HCA Healthcare Inc | Goldman Sachs | (943) |
| (1.376) | General Electric Co | BNP Paribas | 1.761 | 45 | HCA Healthcare Inc | HSBC | (756) |
| (783) | General Mills Inc | Bank of America | | 41 | HCA Healthcare Inc | JP Morgan | (689) |
| | | Merrill Lynch | 5.387 | 225 | HEICO Corp | Bank of America | |
| (167) | General Mills Inc | Barclays Bank | 382 | | | Merrill Lynch | (4.811) |
| (1.337) | General Mills Inc | Goldman Sachs | 9.199 | 132 | HEICO Corp | Barclays Bank | (2.827) |
| (2) | General Mills Inc | HSBC | 13 | 370 | HEICO Corp | Citibank | (7.925) |
| (297) | General Mills Inc | JP Morgan | 1.919 | (179) | Henry Schein Inc | Citibank | 310 |
| 900 | General Motors Co | Barclays Bank | (485) | 1.956 | Hershey Co | Barclays Bank | (8.412) |
| 441 | General Motors Co | BNP Paribas | 106 | 404 | Hershey Co | BNP Paribas | (5.244) |
| 1.025 | General Motors Co | Citibank | (615) | 221 | Hershey Co | Citibank | (1.193) |
| 300 | General Motors Co | Goldman Sachs | 72 | 274 | Hershey Co | Goldman Sachs | (3.557) |
| 347 | General Motors Co | HSBC | (364) | 183 | Hershey Co | HSBC | (3.164) |
| 849 | General Motors Co | JP Morgan | (677) | 3 | Hershey Co | JP Morgan | (52) |
| (60) | Genuine Parts Co | Bank of America | | (77) | Hess Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.217 | | | Merrill Lynch | 751 |
| (751) | Genuine Parts Co | Barclays Bank | 10.510 | (885) | Hess Corp | Barclays Bank | 6.489 |
| (542) | Genuine Parts Co | BNP Paribas | 10.992 | (1.520) | Hess Corp | BNP Paribas | 14.820 |
| (325) | Genuine Parts Co | Citibank | 4.144 | (92) | Hess Corp | Citibank | 753 |
| (190) | Genuine Parts Co | Goldman Sachs | 3.853 | (1.433) | Hess Corp | Goldman Sachs | 13.972 |
| (106) | Genuine Parts Co | HSBC | 2.594 | (106) | Hess Corp | HSBC | 1.271 |
| 173 | Gilead Sciences Inc | Bank of America | | 699 | Hewlett Packard Enterprise Co | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (315) | | | Merrill Lynch | 143 |
| 1.004 | Gilead Sciences Inc | Barclays Bank | (2.068) | 3.564 | Hewlett Packard Enterprise Co | Barclays Bank | 160 |
| 735 | Gilead Sciences Inc | BNP Paribas | (1.338) | | | | |
| 290 | Gilead Sciences Inc | Citibank | (597) | 1.551 | Hewlett Packard Enterprise Co | BNP Paribas | 318 |
| 165 | Gilead Sciences Inc | Goldman Sachs | (300) | 2.961 | Hewlett Packard Enterprise Co | Citibank | (1.195) |
| 223 | Gilead Sciences Inc | HSBC | (453) | 2.736 | Hewlett Packard Enterprise Co | Goldman Sachs | 561 |
| 117 | Gilead Sciences Inc | JP Morgan | (238) | 3.548 | Hewlett Packard Enterprise Co | HSBC | 1.082 |
| (105) | Globe Life Inc | Bank of America | | 2.241 | Hewlett Packard Enterprise Co | JP Morgan | 684 |
| | | Merrill Lynch | 354 | (676) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Barclays Bank | 5.536 |
| (114) | Globe Life Inc | Barclays Bank | 475 | (230) | Hilton Worldwide Holdings Inc | BNP Paribas | 1.817 |
| (1.057) | Globe Life Inc | BNP Paribas | 3.562 | (219) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Citibank | 1.794 |
| (97) | Globe Life Inc | Citibank | 404 | 473 | Hologic Inc | Bank of America | |
| (243) | Globe Life Inc | Goldman Sachs | 819 | | | Merrill Lynch | (1.821) |
| (161) | Globe Life Inc | HSBC | 657 | 1.306 | Hologic Inc | Barclays Bank | (4.062) |
| 377 | GoDaddy Inc 'A' | Barclays Bank | 102 | 736 | Hologic Inc | BNP Paribas | (2.834) |
| 950 | GoDaddy Inc 'A' | BNP Paribas | 1.083 | 548 | Hologic Inc | Citibank | (1.002) |
| 252 | GoDaddy Inc 'A' | Goldman Sachs | 287 | 1.541 | Hologic Inc | Goldman Sachs | (5.933) |
| 482 | GoDaddy Inc 'A' | HSBC | 1.350 | 962 | Hologic Inc | HSBC | (4.406) |
| (7.646) | Grab Holdings Ltd 'A' | Barclays Bank | 879 | (63) | Home Depot Inc | Bank of America | |
| 646 | Graco Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 184 |
| | | Merrill Lynch | (640) | (289) | Home Depot Inc | Barclays Bank | 1.697 |
| 1.844 | Graco Inc | Barclays Bank | (5.182) | (151) | Home Depot Inc | BNP Paribas | 441 |
| 404 | Graco Inc | Citibank | (1.135) | (773) | Home Depot Inc | Citibank | 4.021 |
| 2.702 | Graco Inc | Goldman Sachs | (2.675) | (180) | Home Depot Inc | Goldman Sachs | 526 |
| 149 | Graco Inc | HSBC | (322) | (475) | Home Depot Inc | HSBC | 1.097 |
| 794 | Graco Inc | JP Morgan | (1.715) | (968) | Hormel Foods Corp | Bank of America | |
| 314 | Halliburton Co | Barclays Bank | (371) | | | Merrill Lynch | 1.500 |
| 2.813 | Halliburton Co | BNP Paribas | (169) | (6.730) | Hormel Foods Corp | Barclays Bank | 4.830 |
| 1.515 | Hartford Financial Services Group Inc | Bank of America | | (8.516) | Hormel Foods Corp | BNP Paribas | 13.200 |
| | | Merrill Lynch | (3.151) | (1.240) | Hormel Foods Corp | Citibank | 1.017 |
| 1.609 | Hartford Financial Services Group Inc | Barclays Bank | (4.489) | (4.796) | Hormel Foods Corp | Goldman Sachs | 7.434 |
| 1.602 | Hartford Financial Services Group Inc | BNP Paribas | (3.332) | (1.378) | Hormel Foods Corp | HSBC | 3.541 |
| 1.892 | Hartford Financial Services Group Inc | Goldman Sachs | (3.935) | (1.319) | Hormel Foods Corp | JP Morgan | 3.390 |
| 960 | Hartford Financial Services Group Inc | HSBC | (2.218) | | | | |
| (726) | Hasbro Inc | Barclays Bank | 515 | | | | |
| (2.251) | Hasbro Inc | BNP Paribas | 5.988 | | | | |
| (459) | Hasbro Inc | Citibank | 263 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (502) | Howmet Aerospace Inc | BNP Paribas | 914 | (216) | Intercontinental Exchange Inc | HSBC | 566 |
| (606) | Howmet Aerospace Inc | Goldman Sachs | 1.103 | (252) | International Business Machines Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.366) |
| (311) | Howmet Aerospace Inc | JP Morgan | 342 | (731) | International Business Machines Corp | Barclays Bank | (800) |
| 1.446 | HP Inc | Bank of America Merrill Lynch | 260 | (1.124) | International Business Machines Corp | BNP Paribas | (6.092) |
| 753 | HP Inc | Barclays Bank | (723) | (154) | International Business Machines Corp | Citibank | 107 |
| 2.464 | HP Inc | BNP Paribas | 444 | (1.209) | International Business Machines Corp | Goldman Sachs | (6.553) |
| 712 | HP Inc | HSBC | (313) | (1.247) | International Business Machines Corp | HSBC | (6.709) |
| 98 | Hubbell Inc | Barclays Bank | 331 | (371) | International Business Machines Corp | JP Morgan | (1.996) |
| 641 | Hubbell Inc | BNP Paribas | 7.878 | (129) | International Flavors & Fragrances Inc | Bank of America Merrill Lynch | 920 |
| 120 | Hubbell Inc | Goldman Sachs | 1.475 | (290) | International Flavors & Fragrances Inc | Barclays Bank | 1.789 |
| 17 | Hubbell Inc | JP Morgan | 260 | (788) | International Flavors & Fragrances Inc | BNP Paribas | 5.618 |
| 1 | HubSpot Inc | Barclays Bank | 21 | (280) | International Flavors & Fragrances Inc | Goldman Sachs | 1.996 |
| 41 | HubSpot Inc | BNP Paribas | 1.798 | (266) | International Flavors & Fragrances Inc | HSBC | 5.296 |
| 7 | HubSpot Inc | Citibank | 144 | (661) | International Paper Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.428 |
| 24 | HubSpot Inc | Goldman Sachs | 1.053 | (2.587) | International Paper Co | Barclays Bank | 4.623 |
| 55 | HubSpot Inc | HSBC | 3.855 | (1.167) | International Paper Co | BNP Paribas | 2.521 |
| 45 | Humana Inc | Citibank | 90 | (2.409) | International Paper Co | Citibank | 1.975 |
| 20 | Humana Inc | Goldman Sachs | (462) | (78) | International Paper Co | Goldman Sachs | 168 |
| (885) | Huntington Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (814) | (868) | International Paper Co | HSBC | 2.361 |
| (6.004) | Huntington Bancshares Inc | Barclays Bank | 300 | 2.304 | Interpublic Group of Cos Inc | Barclays Bank | (622) |
| (2.479) | Huntington Bancshares Inc | BNP Paribas | (2.281) | 2.988 | Interpublic Group of Cos Inc | BNP Paribas | 7.111 |
| (984) | Huntington Bancshares Inc | Goldman Sachs | (905) | 833 | Intuit Inc | Barclays Bank | (33.248) |
| 621 | IDEX Corp | BNP Paribas | (4.502) | 98 | Intuit Inc | BNP Paribas | (1.595) |
| 81 | IDEXX Laboratories Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.413) | 37 | Intuit Inc | Goldman Sachs | (602) |
| 178 | IDEXX Laboratories Inc | Barclays Bank | (4.656) | 62 | Intuitive Surgical Inc | Barclays Bank | (706) |
| 146 | IDEXX Laboratories Inc | BNP Paribas | (4.349) | 113 | Intuitive Surgical Inc | BNP Paribas | (657) |
| 101 | IDEXX Laboratories Inc | Citibank | (2.642) | 61 | Intuitive Surgical Inc | Goldman Sachs | (354) |
| 101 | IDEXX Laboratories Inc | Goldman Sachs | (3.009) | 283 | Intuitive Surgical Inc | HSBC | (241) |
| 117 | IDEXX Laboratories Inc | HSBC | (2.976) | 415 | Invesco Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (295) |
| 95 | IDEXX Laboratories Inc | JP Morgan | (2.417) | 377 | Invesco Ltd | Barclays Bank | (260) |
| 158 | Illinois Tool Works Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.547) | 2.006 | Invesco Ltd | BNP Paribas | (1.424) |
| 449 | Illinois Tool Works Inc | Barclays Bank | (3.191) | 1.421 | Invesco Ltd | Goldman Sachs | (1.009) |
| 1.751 | Illinois Tool Works Inc | BNP Paribas | (17.142) | 1.208 | Invesco Ltd | HSBC | (2.162) |
| 108 | Illinois Tool Works Inc | Goldman Sachs | (1.057) | 63 | IQVIA Holdings Inc | Goldman Sachs | 301 |
| 51 | Illinois Tool Works Inc | JP Morgan | (467) | 55 | IQVIA Holdings Inc | HSBC | 354 |
| (63) | illumina Inc | Bank of America Merrill Lynch | 677 | 523 | J M Smucker Co | Citibank | (1.066) |
| (45) | illumina Inc | Barclays Bank | 663 | (419) | Jack Henry & Associates Inc | Barclays Bank | 951 |
| (108) | illumina Inc | BNP Paribas | 1.160 | (1.805) | Jack Henry & Associates Inc | BNP Paribas | 11.263 |
| (117) | illumina Inc | Citibank | 778 | (73) | Jack Henry & Associates Inc | Citibank | 166 |
| (55) | illumina Inc | HSBC | 87 | (1.234) | Jack Henry & Associates Inc | Goldman Sachs | 7.700 |
| 500 | Incyte Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.135) | 413 | Jazz Pharmaceuticals Plc | Barclays Bank | (1.378) |
| 879 | Incyte Corp | Barclays Bank | (2.162) | 316 | Jazz Pharmaceuticals Plc | BNP Paribas | (2.673) |
| 3.696 | Incyte Corp | BNP Paribas | (15.782) | 700 | Jazz Pharmaceuticals Plc | Citibank | (3.109) |
| 508 | Incyte Corp | Citibank | (483) | 241 | Jazz Pharmaceuticals Plc | Goldman Sachs | (2.039) |
| 851 | Incyte Corp | Goldman Sachs | (3.634) | 136 | Jazz Pharmaceuticals Plc | HSBC | (1.254) |
| 135 | Incyte Corp | HSBC | (521) | 92 | JB Hunt Transport Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (764) |
| 471 | Incyte Corp | JP Morgan | (1.818) | 552 | JB Hunt Transport Services Inc | Barclays Bank | (891) |
| 1.309 | Ingersoll Rand Inc | Barclays Bank | (2.245) | | | | |
| 430 | Ingersoll Rand Inc | Citibank | (766) | | | | |
| (196) | Insulet Corp | Barclays Bank | 6.337 | | | | |
| (67) | Insulet Corp | Citibank | (42) | | | | |
| (73) | Insulet Corp | Goldman Sachs | 3.400 | | | | |
| (34) | Insulet Corp | HSBC | 1.522 | | | | |
| (3.355) | Intel Corp | Barclays Bank | (1.897) | | | | |
| (427) | Intel Corp | BNP Paribas | (226) | | | | |
| (425) | Intel Corp | Goldman Sachs | (225) | | | | |
| (751) | Intel Corp | JP Morgan | 330 | | | | |
| (122) | Intercontinental Exchange Inc | Bank of America Merrill Lynch | 642 | | | | |
| (6) | Intercontinental Exchange Inc | BNP Paribas | 32 | | | | |
| (133) | Intercontinental Exchange Inc | Citibank | 609 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.093 | JB Hunt Transport Services Inc | BNP Paribas | (9.077) | 167 | KLA Corp | Barclays Bank | 5.033 |
| 181 | JB Hunt Transport Services Inc | Citibank | (588) | 683 | KLA Corp | BNP Paribas | 31.999 |
| 113 | JB Hunt Transport Services Inc | Goldman Sachs | (938) | 29 | KLA Corp | Citibank | 874 |
| 82 | JB Hunt Transport Services Inc | HSBC | (907) | 79 | KLA Corp | Goldman Sachs | 3.701 |
| 44 | Johnson & Johnson | Bank of America | | 80 | KLA Corp | HSBC | 5.394 |
| 109 | Johnson & Johnson | Merrill Lynch | (242) | 3.031 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Barclays Bank | 515 |
| 25 | Johnson & Johnson | Barclays Bank | (306) | 822 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | JP Morgan | (1.866) |
| (522) | Johnson Controls International Plc | JP Morgan | (206) | (628) | Kraft Heinz Co | Barclays Bank | 578 |
| (626) | Johnson Controls International Plc | Goldman Sachs | 934 | (241) | Kroger Co | Bank of America | |
| (257) | JPMorgan Chase & Co | HSBC | 1.540 | 196 | Laboratory Corp of America Holdings | Merrill Lynch | 848 |
| (1.489) | JPMorgan Chase & Co | Bank of America | | 97 | Laboratory Corp of America Holdings | Bank of America | (2.609) |
| (405) | JPMorgan Chase & Co | Merrill Lynch | (10) | 43 | Laboratory Corp of America Holdings | Barclays Bank | (876) |
| (93) | JPMorgan Chase & Co | BNP Paribas | (60) | 39 | Laboratory Corp of America Holdings | BNP Paribas | (572) |
| (11) | JPMorgan Chase & Co | Citibank | 1.118 | 95 | Laboratory Corp of America Holdings | Goldman Sachs | (519) |
| 307 | Juniper Networks Inc | Goldman Sachs | (4) | 103 | Laboratory Corp of America Holdings | HSBC | (1.233) |
| 3.726 | Juniper Networks Inc | HSBC | 20 | 100 | Lam Research Corp | JP Morgan | (1.337) |
| 424 | Juniper Networks Inc | Bank of America | 347 | 73 | Lam Research Corp | Bank of America | |
| 383 | Juniper Networks Inc | Merrill Lynch | 2.459 | 306 | Lam Research Corp | Merrill Lynch | 7.389 |
| 3.477 | Juniper Networks Inc | Barclays Bank | 479 | 82 | Lam Research Corp | Barclays Bank | 3.000 |
| 862 | Juniper Networks Inc | BNP Paribas | 253 | 111 | Lam Research Corp | BNP Paribas | 22.610 |
| 725 | Juniper Networks Inc | Goldman Sachs | 3.929 | 43 | Lam Research Corp | Citibank | 3.369 |
| (237) | Kellogg Co | HSBC | 1.310 | 110 | Lamb Weston Holdings Inc | Goldman Sachs | 8.202 |
| (324) | Kellogg Co | JP Morgan | 1.102 | 185 | Lamb Weston Holdings Inc | HSBC | 4.273 |
| (790) | Kellogg Co | Barclays Bank | 574 | (1.569) | Las Vegas Sands Corp | Barclays Bank | 97 |
| (341) | Kellogg Co | BNP Paribas | 1.361 | (496) | Las Vegas Sands Corp | Citibank | 95 |
| (621) | Keurig Dr Pepper Inc | Goldman Sachs | 3.318 | (3.875) | Las Vegas Sands Corp | Barclays Bank | 4.125 |
| (4.111) | Keurig Dr Pepper Inc | JP Morgan | 1.777 | (184) | Lear Corp | Goldman Sachs | 20.692 |
| (1.783) | Keurig Dr Pepper Inc | Bank of America | 925 | (173) | Lear Corp | Bank of America | |
| (657) | Keurig Dr Pepper Inc | Merrill Lynch | 6.125 | (307) | Lear Corp | Merrill Lynch | (103) |
| (1.821) | KeyCorp | BNP Paribas | 6.125 | (318) | Lear Corp | Barclays Bank | 491 |
| (969) | KeyCorp | Goldman Sachs | 2.657 | (217) | Lear Corp | BNP Paribas | (172) |
| (4.340) | KeyCorp | HSBC | 1.301 | 97 | Lennar Corp 'A' | Citibank | 903 |
| (1.068) | KeyCorp | Bank of America | | 202 | Lennar Corp 'A' | HSBC | 896 |
| (2.327) | KeyCorp | Merrill Lynch | (146) | 279 | Lennox International Inc | Citibank | (326) |
| 80 | Keysight Technologies Inc | Barclays Bank | 591 | 300 | Lennox International Inc | JP Morgan | (1.525) |
| 822 | Keysight Technologies Inc | BNP Paribas | (347) | 105 | Lennox International Inc | Barclays Bank | (695) |
| 1.436 | Keysight Technologies Inc | Goldman Sachs | 16.630 | 106 | Lennox International Inc | BNP Paribas | (2.418) |
| 255 | Keysight Technologies Inc | JP Morgan | 2.854 | 156 | Lennox International Inc | Citibank | (261) |
| 1.187 | Keysight Technologies Inc | Bank of America | | (1.056) | Liberty Broadband Corp 'C' | Goldman Sachs | (854) |
| 145 | Keysight Technologies Inc | Merrill Lynch | 824 | (254) | Liberty Broadband Corp 'C' | HSBC | (551) |
| (75) | Kimberly-Clark Corp | Barclays Bank | 5.130 | (257) | Liberty Broadband Corp 'C' | Barclays Bank | 2.946 |
| (821) | Kimberly-Clark Corp | BNP Paribas | 2.143 | (3.087) | Liberty Global Plc 'A' | Goldman Sachs | 803 |
| (195) | Kimberly-Clark Corp | Citibank | 638 | 651 | Liberty Global Plc 'C' | HSBC | 1.239 |
| (186) | Kimberly-Clark Corp | Goldman Sachs | 2.297 | (3.855) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Barclays Bank | 2.099 |
| (209) | Kimberly-Clark Corp | HSBC | 2.210 | (568) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Bank of America | (749) |
| (186) | Kimberly-Clark Corp | Barclays Bank | 240 | (250) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Merrill Lynch | 17.926 |
| (572) | Kinder Morgan Inc | BNP Paribas | 2.191 | (32) | Linde Plc | Barclays Bank | 1.130 |
| (3.713) | Kinder Morgan Inc | Citibank | 1.039 | (431) | Linde Plc | Goldman Sachs | 1.163 |
| (3.917) | Kinder Morgan Inc | Goldman Sachs | 821 | (340) | Linde Plc | Bank of America | |
| (1.391) | Kinder Morgan Inc | Bank of America | | (93) | Linde Plc | Merrill Lynch | 456 |
| 184 | KKR & Co Inc | Merrill Lynch | 462 | (100) | Linde Plc | Barclays Bank | 5.107 |
| 403 | KKR & Co Inc | Barclays Bank | 173 | (117) | Linde Plc | BNP Paribas | 4.848 |
| 305 | KKR & Co Inc | BNP Paribas | 766 | | | Citibank | 1.102 |
| 346 | KKR & Co Inc | Goldman Sachs | 868 | | | HSBC | 1.113 |
| 226 | KKR & Co Inc | JP Morgan | 522 | | | JP Morgan | 1.302 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (136) | Live Nation Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 24 | (135) | MarketAxess Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.371 |
| (1.277) | Live Nation Entertainment Inc | Barclays Bank | 5.798 | (4) | MarketAxess Holdings Inc | HSBC | 94 |
| (425) | Live Nation Entertainment Inc | Citibank | 1.930 | (695) | Marriott International Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 5.963 |
| (380) | Live Nation Entertainment Inc | HSBC | (908) | (1.357) | Marriott International Inc 'A' | Barclays Bank | 10.530 |
| 430 | LKQ Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.258) | (88) | Marriott International Inc 'A' | BNP Paribas | 755 |
| 1.268 | LKQ Corp | Barclays Bank | (4.438) | (128) | Marriott International Inc 'A' | Citibank | 993 |
| 1.280 | LKQ Corp | BNP Paribas | (6.720) | (646) | Marriott International Inc 'A' | Goldman Sachs | 5.543 |
| 2.373 | LKQ Corp | Goldman Sachs | (12.458) | (152) | Marriott International Inc 'A' | HSBC | 1.677 |
| 804 | LKQ Corp | HSBC | (4.438) | 103 | Marsh & McLennan Cos Inc | Barclays Bank | (756) |
| (353) | Loews Corp | Bank of America Merrill Lynch | 618 | (81) | Martin Marietta Materials Inc | Barclays Bank | 923 |
| (327) | Loews Corp | Barclays Bank | 670 | (153) | Martin Marietta Materials Inc | BNP Paribas | 1.525 |
| (296) | Loews Corp | Citibank | 607 | (255) | Martin Marietta Materials Inc | Citibank | 2.526 |
| (1.136) | Loews Corp | Goldman Sachs | 1.988 | (282) | Martin Marietta Materials Inc | Goldman Sachs | 2.812 |
| (316) | Loews Corp | HSBC | 689 | (193) | Martin Marietta Materials Inc | HSBC | 342 |
| 266 | Lowe's Cos Inc | Barclays Bank | (373) | (3.055) | Marvell Technology Inc | Barclays Bank | (47.383) |
| 651 | Lowe's Cos Inc | BNP Paribas | 430 | (346) | Marvell Technology Inc | Citibank | (5.366) |
| 188 | Lowe's Cos Inc | Goldman Sachs | 124 | (1.942) | Marvell Technology Inc | HSBC | (40.665) |
| 85 | Lowe's Cos Inc | HSBC | (156) | (221) | Masco Corp | Bank of America Merrill Lynch | 645 |
| (53) | LPL Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (244) | (788) | Masco Corp | Barclays Bank | 2.049 |
| (211) | LPL Financial Holdings Inc | Barclays Bank | 516 | (283) | Masco Corp | HSBC | 1.259 |
| (347) | LPL Financial Holdings Inc | BNP Paribas | (1.600) | (156) | Masimo Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.175 |
| (164) | LPL Financial Holdings Inc | Citibank | 382 | (188) | Masimo Corp | Barclays Bank | 174 |
| (44) | LPL Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | (203) | (121) | Masimo Corp | BNP Paribas | 1.687 |
| (88) | LPL Financial Holdings Inc | JP Morgan | (225) | (181) | Match Group Inc | Barclays Bank | (76) |
| (763) | Lucid Group Inc | BNP Paribas | (389) | (754) | Match Group Inc | BNP Paribas | (1.478) |
| 250 | Lululemon Athletica Inc | Barclays Bank | (7.925) | (1.141) | Match Group Inc | Goldman Sachs | (2.236) |
| 100 | Lululemon Athletica Inc | BNP Paribas | (4.429) | (269) | McCormick & Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.622 |
| 233 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.088) | (400) | McCormick & Co Inc | Barclays Bank | 1.160 |
| 1.327 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Barclays Bank | (5.856) | (1.251) | McCormick & Co Inc | BNP Paribas | 7.544 |
| 897 | LyondellBasell Industries NV 'A' | BNP Paribas | (4.189) | (221) | McCormick & Co Inc | Goldman Sachs | 1.333 |
| 556 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Citibank | (2.218) | (649) | McCormick & Co Inc | HSBC | 2.252 |
| 151 | LyondellBasell Industries NV 'A' | Goldman Sachs | (705) | 160 | McDonald's Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.885) |
| 607 | LyondellBasell Industries NV 'A' | HSBC | (3.836) | 318 | McDonald's Corp | Barclays Bank | (1.663) |
| 173 | LyondellBasell Industries NV 'A' | JP Morgan | (1.012) | 215 | McDonald's Corp | BNP Paribas | (2.533) |
| (333) | M&T Bank Corp | Barclays Bank | 551 | 101 | McDonald's Corp | Citibank | (528) |
| (1.086) | M&T Bank Corp | BNP Paribas | (8.069) | 339 | McDonald's Corp | Goldman Sachs | (3.993) |
| (162) | M&T Bank Corp | Citibank | (36) | 127 | McKesson Corp | Barclays Bank | (1.504) |
| (133) | M&T Bank Corp | Goldman Sachs | (988) | 75 | McKesson Corp | BNP Paribas | (492) |
| (82) | M&T Bank Corp | JP Morgan | (499) | 86 | McKesson Corp | Citibank | (1.018) |
| 583 | Marathon Oil Corp | Barclays Bank | (635) | 30 | McKesson Corp | Goldman Sachs | (197) |
| 1.959 | Marathon Oil Corp | BNP Paribas | (646) | (1.669) | Medtronic Plc | Barclays Bank | 1.306 |
| 940 | Marathon Oil Corp | Goldman Sachs | (310) | (187) | Medtronic Plc | BNP Paribas | 1.333 |
| 1.691 | Marathon Oil Corp | HSBC | (812) | (614) | Medtronic Plc | Citibank | 4.494 |
| (197) | Marathon Petroleum Corp | Citibank | 1.048 | (265) | Medtronic Plc | Goldman Sachs | 1.889 |
| (33) | Markel Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.381 | (14) | MercadoLibre Inc | Barclays Bank | 1.383 |
| (32) | Markel Group Inc | Barclays Bank | 963 | (10) | MercadoLibre Inc | BNP Paribas | 560 |
| (18) | Markel Group Inc | BNP Paribas | 753 | (35) | MercadoLibre Inc | Goldman Sachs | 1.959 |
| (1) | Markel Group Inc | Goldman Sachs | 42 | 158 | Meta Platforms Inc 'A' | HSBC | 4.574 |
| (18) | Markel Group Inc | HSBC | 810 | 54 | MetLife Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9) |
| (284) | MarketAxess Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.987 | 3.017 | MetLife Inc | Barclays Bank | (6.185) |
| (167) | MarketAxess Holdings Inc | Barclays Bank | 1.338 | 1.881 | MetLife Inc | Goldman Sachs | (301) |
| (29) | MarketAxess Holdings Inc | BNP Paribas | 509 | 618 | MetLife Inc | HSBC | (2.083) |
| (50) | MarketAxess Holdings Inc | Citibank | 145 | 202 | MetLife Inc | JP Morgan | (681) |
| | | | | 84 | Mettler-Toledo International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.064) |
| | | | | 86 | Mettler-Toledo International Inc | Barclays Bank | (7.316) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 72 | Mettler-Toledo International Inc | BNP Paribas | (6.054) | (348) | Mosaic Co | Goldman Sachs | 1.416 |
| 24 | Mettler-Toledo International Inc | Citibank | (2.323) | (232) | Mosaic Co | JP Morgan | 1.227 |
| 120 | Mettler-Toledo International Inc | Goldman Sachs | (10.091) | (39) | Motorola Solutions Inc | Bank of America | |
| 26 | Mettler-Toledo International Inc | HSBC | (2.392) | (248) | Motorola Solutions Inc | Merrill Lynch | 280 |
| 371 | MGM Resorts International | Bank of America | (1.302) | (349) | Motorola Solutions Inc | Barclays Bank | 1.720 |
| 1.998 | MGM Resorts International | Merrill Lynch | (6.294) | (272) | Motorola Solutions Inc | BNP Paribas | 2.502 |
| 364 | MGM Resorts International | Barclays Bank | (1.278) | (543) | Motorola Solutions Inc | Citibank | 1.082 |
| 236 | MGM Resorts International | BNP Paribas | (235) | (216) | Motorola Solutions Inc | Goldman Sachs | 3.893 |
| 1.358 | MGM Resorts International | Goldman Sachs | (4.767) | 29 | MSCI Inc | JP Morgan | 41 |
| 623 | Microchip Technology Inc | Bank of America | 486 | 29 | MSCI Inc | Bank of America | |
| 1.812 | Microchip Technology Inc | Merrill Lynch | (4.732) | 73 | MSCI Inc | Merrill Lynch | 176 |
| 1.339 | Microchip Technology Inc | Barclays Bank | 1.044 | (1.958) | Nasdaq Inc | Barclays Bank | (352) |
| 525 | Microchip Technology Inc | BNP Paribas | (1.591) | (1.482) | Nasdaq Inc | BNP Paribas | 978 |
| 902 | Microchip Technology Inc | Citibank | (235) | (399) | Nasdaq Inc | Citibank | 379 |
| 832 | Microchip Technology Inc | Goldman Sachs | 704 | (1.355) | Nasdaq Inc | Goldman Sachs | 894 |
| 401 | Microchip Technology Inc | HSBC | 1.572 | (280) | Nasdaq Inc | HSBC | 115 |
| (261) | Micron Technology Inc | JP Morgan | (634) | 190 | NetApp Inc | Bank of America | |
| (477) | Micron Technology Inc | Barclays Bank | (1.918) | 1.073 | NetApp Inc | Merrill Lynch | 581 |
| (721) | Micron Technology Inc | BNP Paribas | (1.752) | 5.044 | NetApp Inc | Barclays Bank | 730 |
| (274) | Micron Technology Inc | Citibank | (2.134) | 738 | NetApp Inc | BNP Paribas | 15.435 |
| 86 | Microsoft Corp | HSBC | 308 | 233 | NetApp Inc | Goldman Sachs | 2.258 |
| 425 | Microsoft Corp | Barclays Bank | 10.769 | (46) | Netflix Inc | JP Morgan | 888 |
| 46 | Microsoft Corp | BNP Paribas | 408 | | | Bank of America | |
| 55 | Microsoft Corp | Citibank | 1.394 | (57) | Netflix Inc | Merrill Lynch | (2.682) |
| 973 | Microsoft Corp | Goldman Sachs | 25.444 | 103 | Neurocrine Biosciences Inc | BNP Paribas | (3.324) |
| (130) | Moderna Inc | JP Morgan | (202) | 150 | Neurocrine Biosciences Inc | Bank of America | |
| (265) | Moderna Inc | Barclays Bank | 522 | 210 | Neurocrine Biosciences Inc | Merrill Lynch | (761) |
| (606) | Moderna Inc | BNP Paribas | (634) | 135 | Neurocrine Biosciences Inc | Barclays Bank | (411) |
| (466) | Moderna Inc | Citibank | 918 | 315 | Neurocrine Biosciences Inc | Citibank | (575) |
| 54 | Molina Healthcare Inc | Goldman Sachs | (1.221) | 136 | Neurocrine Biosciences Inc | Goldman Sachs | (998) |
| 1.621 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Bank of America | (5.122) | (2.109) | Neurocrine Biosciences Inc | HSBC | (2.249) |
| (421) | Mondelez International Inc 'A' | Merrill Lynch | (138) | (2.235) | Newell Brands Inc | JP Morgan | (971) |
| (133) | MongoDB Inc | HSBC | (2.796) | (4.441) | Newell Brands Inc | Bank of America | 1.708 |
| (58) | MongoDB Inc | Barclays Bank | (806) | (4.800) | Newell Brands Inc | Merrill Lynch | 1.028 |
| (70) | MongoDB Inc | BNP Paribas | (1.471) | (1.346) | Newell Brands Inc | Barclays Bank | 1.028 |
| (65) | MongoDB Inc | Goldman Sachs | (3.267) | (233) | Newmont Corp | BNP Paribas | 3.597 |
| 159 | Monolithic Power Systems Inc | HSBC | 10.112 | (580) | Newmont Corp | Goldman Sachs | 3.888 |
| 9 | Monolithic Power Systems Inc | Barclays Bank | 572 | (473) | Newmont Corp | HSBC | 2.248 |
| 616 | Monster Beverage Corp | Merrill Lynch | (1.109) | (228) | Newmont Corp | Bank of America | |
| 636 | Monster Beverage Corp | Barclays Bank | (432) | (1.333) | Newmont Corp | Merrill Lynch | 1.622 |
| 346 | Monster Beverage Corp | BNP Paribas | (623) | 870 | News Corp 'A' | Barclays Bank | 83 |
| 814 | Monster Beverage Corp | Goldman Sachs | (912) | 2.117 | News Corp 'A' | Goldman Sachs | (307) |
| 374 | Monster Beverage Corp | HSBC | (419) | 50 | News Corp 'A' | HSBC | 74 |
| 70 | Moody's Corp | JP Morgan | 88 | (346) | NextEra Energy Inc | Bank of America | |
| 49 | Moody's Corp | Bank of America | (443) | (1.950) | NextEra Energy Inc | Merrill Lynch | 1.851 |
| 72 | Moody's Corp | Merrill Lynch | 90 | (291) | NextEra Energy Inc | Barclays Bank | 5.523 |
| 99 | Moody's Corp | Barclays Bank | (630) | (1.203) | NextEra Energy Inc | BNP Paribas | 10.432 |
| 195 | Moody's Corp | BNP Paribas | 244 | (310) | NextEra Energy Inc | Citibank | 695 |
| 329 | Moody's Corp | Citibank | 2.102 | 73 | NIKE Inc 'B' | Goldman Sachs | 6.436 |
| 99 | Moody's Corp | Goldman Sachs | 633 | | | HSBC | 1.200 |
| 417 | Morgan Stanley | HSBC | (163) | 470 | Nordson Corp | Bank of America | |
| 40 | Morgan Stanley | JP Morgan | 12 | 247 | Nordson Corp | Merrill Lynch | 1.095 |
| 45 | Morgan Stanley | Bank of America | (84) | 1.094 | Nordson Corp | Barclays Bank | 635 |
| (675) | Mosaic Co | Merrill Lynch | 2.329 | 50 | Norfolk Southern Corp | BNP Paribas | 398 |
| (544) | Mosaic Co | Barclays Bank | 1.877 | | | Goldman Sachs | 1.761 |
| | | Citibank | | | | Barclays Bank | (519) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 118 | Norfolk Southern Corp | HSBC | 93 | 14 | O'Reilly Automotive Inc | JP Morgan | (788) |
| (282) | Northern Trust Corp | Bank of America | | 1.090 | Otis Worldwide Corp | Barclays Bank | (4.567) |
| | | Merrill Lynch | (321) | 3.327 | Otis Worldwide Corp | BNP Paribas | (15.371) |
| (1.001) | Northern Trust Corp | Barclays Bank | 1.051 | 284 | Otis Worldwide Corp | Citibank | (843) |
| (660) | Northern Trust Corp | BNP Paribas | (752) | 839 | Otis Worldwide Corp | Goldman Sachs | (3.876) |
| (293) | Northern Trust Corp | Citibank | 328 | 318 | Otis Worldwide Corp | HSBC | (1.867) |
| (265) | Northern Trust Corp | Goldman Sachs | (302) | 769 | Ovintiv Inc | Bank of America | |
| (67) | Novocure Ltd | Barclays Bank | 506 | | | Merrill Lynch | (492) |
| (354) | Novocure Ltd | BNP Paribas | 1.604 | 831 | Ovintiv Inc | Barclays Bank | (1.994) |
| (170) | Novocure Ltd | Citibank | 1.284 | 959 | Ovintiv Inc | BNP Paribas | (614) |
| (310) | Novocure Ltd | Goldman Sachs | 1.404 | 1.080 | Ovintiv Inc | HSBC | (2.344) |
| (158) | Novocure Ltd | HSBC | (618) | 546 | Ovintiv Inc | JP Morgan | (1.185) |
| (7.112) | NRG Energy Inc | Barclays Bank | 3.980 | 962 | Owens Corning | Barclays Bank | (1.991) |
| (1.935) | NRG Energy Inc | Citibank | 1.219 | 248 | Owens Corning | BNP Paribas | 82 |
| 110 | Nucor Corp | Bank of America | | 216 | Owens Corning | Citibank | (447) |
| | | Merrill Lynch | (1.141) | 572 | Owens Corning | Goldman Sachs | 189 |
| 624 | Nucor Corp | Barclays Bank | (5.466) | 363 | Owens Corning | HSBC | 603 |
| 271 | Nucor Corp | BNP Paribas | (2.810) | (383) | PACCAR Inc | Bank of America | |
| 272 | Nucor Corp | Goldman Sachs | (2.821) | | | Merrill Lynch | 1.084 |
| 147 | Nucor Corp | HSBC | (1.692) | (442) | PACCAR Inc | BNP Paribas | 1.251 |
| 94 | NVIDIA Corp | Bank of America | | (669) | PACCAR Inc | Goldman Sachs | 1.893 |
| | | Merrill Lynch | 10.091 | (395) | Packaging Corp of America | Barclays Bank | 1.813 |
| 223 | NVIDIA Corp | Barclays Bank | 16.122 | (483) | Packaging Corp of America | BNP Paribas | 2.879 |
| 60 | NVIDIA Corp | Citibank | 5.107 | (486) | Packaging Corp of America | Citibank | 2.231 |
| 185 | NVIDIA Corp | Goldman Sachs | 19.860 | (7.910) | Palantir Technologies Inc 'A' | Barclays Bank | (19.380) |
| 41 | NVIDIA Corp | JP Morgan | 4.320 | (5.611) | Palantir Technologies Inc 'A' | Citibank | (13.747) |
| 8 | NVR Inc | Bank of America | | 208 | Palo Alto Networks Inc | Barclays Bank | 4.738 |
| | | Merrill Lynch | (2.444) | 303 | Palo Alto Networks Inc | BNP Paribas | 6.633 |
| 27 | NVR Inc | Barclays Bank | (2.519) | 63 | Palo Alto Networks Inc | Citibank | 151 |
| 47 | NVR Inc | BNP Paribas | (14.359) | 160 | Palo Alto Networks Inc | Goldman Sachs | 3.502 |
| 41 | NVR Inc | Goldman Sachs | (12.526) | 209 | Palo Alto Networks Inc | JP Morgan | 4.884 |
| 9 | NVR Inc | HSBC | (2.341) | (552) | Paramount Global 'B' | Bank of America | |
| 12 | NVR Inc | JP Morgan | (3.122) | | | Merrill Lynch | 108 |
| 56 | NXP Semiconductors NV | Bank of America | | (2.576) | Paramount Global 'B' | Barclays Bank | (1.610) |
| | | Merrill Lynch | 729 | (3.776) | Paramount Global 'B' | BNP Paribas | 736 |
| 416 | NXP Semiconductors NV | Barclays Bank | 1.489 | (2.451) | Paramount Global 'B' | HSBC | 3.370 |
| 123 | NXP Semiconductors NV | BNP Paribas | 1.601 | 165 | Parker-Hannifin Corp | BNP Paribas | (289) |
| 185 | NXP Semiconductors NV | Citibank | 380 | 234 | Paychex Inc | Bank of America | |
| 281 | NXP Semiconductors NV | Goldman Sachs | 3.659 | | | Merrill Lynch | (531) |
| 278 | NXP Semiconductors NV | HSBC | 3.586 | 1.970 | Paychex Inc | Barclays Bank | (8.057) |
| 132 | NXP Semiconductors NV | JP Morgan | 1.703 | 206 | Paychex Inc | BNP Paribas | (468) |
| (171) | Occidental Petroleum Corp | Barclays Bank | 192 | 133 | Paychex Inc | Citibank | (544) |
| (671) | Occidental Petroleum Corp | HSBC | 698 | 848 | Paychex Inc | Goldman Sachs | (1.925) |
| (461) | Okta Inc | Barclays Bank | (559) | 92 | Paychex Inc | HSBC | (40) |
| (1.059) | Okta Inc | BNP Paribas | (13.153) | 111 | Paycom Software Inc | Barclays Bank | (1.036) |
| (926) | Okta Inc | Goldman Sachs | (11.501) | 31 | Paycom Software Inc | Citibank | (289) |
| 86 | Old Dominion Freight Line Inc | BNP Paribas | 166 | (312) | Paylocity Holding Corp | BNP Paribas | (883) |
| 319 | Old Dominion Freight Line Inc | Goldman Sachs | 616 | (53) | Paylocity Holding Corp | Citibank | 95 |
| 406 | Old Dominion Freight Line Inc | HSBC | (1.311) | (49) | Paylocity Holding Corp | Goldman Sachs | (139) |
| 441 | Omnicom Group Inc | Citibank | (1.169) | (213) | Paylocity Holding Corp | HSBC | 275 |
| 1.086 | Omnicom Group Inc | HSBC | (1.987) | (48) | Paylocity Holding Corp | JP Morgan | 62 |
| 387 | Omnicom Group Inc | JP Morgan | (708) | 557 | PayPal Holdings Inc | Barclays Bank | (123) |
| (128) | ON Semiconductor Corp | Barclays Bank | 193 | 150 | PayPal Holdings Inc | HSBC | (1.907) |
| (1.332) | ONEOK Inc | Barclays Bank | 2.145 | 215 | PayPal Holdings Inc | JP Morgan | (2.733) |
| 118 | Oracle Corp | Bank of America | | 1 | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) [†] | BNP Paribas | — |
| | | Merrill Lynch | 923 | (1.134) | Pentair Plc | Bank of America | |
| 378 | Oracle Corp | Barclays Bank | 1.567 | (2.295) | Pentair Plc | Merrill Lynch | 3.402 |
| 479 | Oracle Corp | BNP Paribas | 3.746 | (1.338) | Pentair Plc | Barclays Bank | 7.023 |
| 796 | Oracle Corp | Citibank | 2.731 | (187) | Pentair Plc | BNP Paribas | 4.014 |
| 747 | Oracle Corp | Goldman Sachs | 5.842 | (244) | Pentair Plc | Citibank | 572 |
| 47 | O'Reilly Automotive Inc | Bank of America | | (457) | Pentair Plc | Goldman Sachs | 732 |
| | | Merrill Lynch | (2.581) | (189) | Pentair Plc | HSBC | 1.115 |
| 94 | O'Reilly Automotive Inc | Barclays Bank | (3.549) | 1.085 | PepsiCo Inc | JP Morgan | 461 |
| 215 | O'Reilly Automotive Inc | BNP Paribas | (11.806) | | | Bank of America | (13.096) |
| 155 | O'Reilly Automotive Inc | Goldman Sachs | (8.511) | 2.276 | PepsiCo Inc | Barclays Bank | (6.582) |
| 52 | O'Reilly Automotive Inc | HSBC | (2.926) | 84 | PepsiCo Inc | BNP Paribas | (1.014) |
| | | | | 329 | PepsiCo Inc | Citibank | (1.461) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 454 | PepsiCo Inc | Goldman Sachs | (5.480) | (1.167) | Public Service Enterprise Group Inc | Barclays Bank | 3.349 |
| 81 | PepsiCo Inc | HSBC | (903) | (422) | Public Service Enterprise Group Inc | BNP Paribas | 1.346 |
| (448) | Pfizer Inc | BNP Paribas | (5) | (976) | Public Service Enterprise Group Inc | HSBC | 4.031 |
| (154) | Pfizer Inc | Goldman Sachs | (14) | 981 | PulteGroup Inc | Bank of America | (2.158) |
| (475) | Pfizer Inc | HSBC | 1.014 | 937 | PulteGroup Inc | Barclays Bank | (796) |
| (685) | Pfizer Inc | Bank of America | | 1.588 | PulteGroup Inc | BNP Paribas | (3.494) |
| (139) | PG&E Corp | Merrill Lynch | 42 | 674 | PulteGroup Inc | Citibank | (180) |
| (3.137) | PG&E Corp | BNP Paribas | 941 | 691 | Qorvo Inc | Barclays Bank | 1.781 |
| (678) | PG&E Corp | Citibank | (176) | 243 | Qorvo Inc | Citibank | (443) |
| (3.207) | PG&E Corp | Goldman Sachs | 962 | 265 | Qorvo Inc | Goldman Sachs | 1.379 |
| (199) | Phillips 66 | Bank of America | | 97 | QUALCOMM Inc | Bank of America | 700 |
| (811) | Phillips 66 | Merrill Lynch | 466 | 89 | QUALCOMM Inc | Barclays Bank | 732 |
| (116) | Phillips 66 | Barclays Bank | 2.984 | 1.146 | QUALCOMM Inc | BNP Paribas | 8.274 |
| (254) | Phillips 66 | BNP Paribas | 271 | 358 | QUALCOMM Inc | Goldman Sachs | 2.585 |
| 491 | Pinterest Inc 'A' | Citibank | 935 | 230 | QUALCOMM Inc | HSBC | 1.194 |
| 1.492 | Pinterest Inc 'A' | Barclays Bank | 322 | 197 | QUALCOMM Inc | JP Morgan | 1.022 |
| 1.339 | Pinterest Inc 'A' | BNP Paribas | 2.783 | (261) | Quanta Services Inc | Bank of America | (1.305) |
| 427 | Pinterest Inc 'A' | Citibank | 26 | (99) | Quanta Services Inc | Barclays Bank | (873) |
| 1.272 | Pinterest Inc 'A' | Goldman Sachs | 796 | (193) | Quanta Services Inc | BNP Paribas | (965) |
| (112) | Pioneer Natural Resources Co | BNP Paribas | 2.957 | 98 | Quest Diagnostics Inc | BNP Paribas | 77 |
| (117) | Pioneer Natural Resources Co | Goldman Sachs | 1.074 | (234) | Raymond James Financial Inc | Goldman Sachs | 754 |
| (14.390) | Plug Power Inc | JP Morgan | 3.604 | (606) | Raymond James Financial Inc | Bank of America | (1.252) |
| (12.620) | Plug Power Inc | Barclays Bank | (9.213) | (320) | Raymond James Financial Inc | Merrill Lynch | (812) |
| (6.831) | Plug Power Inc | BNP Paribas | (4.987) | (119) | Raymond James Financial Inc | Barclays Bank | (1.712) |
| (372) | Plug Power Inc | Citibank | 264 | (27) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | BNP Paribas | (1.712) |
| (80) | PNC Financial Services Group Inc | Goldman Sachs | (263) | (40) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (637) |
| (488) | PNC Financial Services Group Inc | HSBC | 1.260 | (37) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Bank of America | 516 |
| (1.908) | PNC Financial Services Group Inc | Barclays Bank | 1.734 | (39) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | 727 |
| (620) | PNC Financial Services Group Inc | HSBC | (2.625) | (54) | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 745 |
| (798) | PNC Financial Services Group Inc | Merrill Lynch | 28 | (1.491) | Regions Financial Corp | HSBC | 1.095 |
| (924) | PNC Financial Services Group Inc | Barclays Bank | 1.955 | 203 | Reliance Steel & Aluminum Co | Barclays Bank | 149 |
| (97) | Pool Corp | BNP Paribas | 4.691 | 1.620 | Reliance Steel & Aluminum Co | Barclays Bank | (2.513) |
| (287) | Pool Corp | Citibank | 3.022 | (75) | Repligen Corp | BNP Paribas | (13.932) |
| (150) | Pool Corp | Goldman Sachs | 2.669 | (211) | Repligen Corp | Bank of America | (1.274) |
| (129) | Pool Corp | Merrill Lynch | 1.411 | (367) | Repligen Corp | Merrill Lynch | (426) |
| (70) | Pool Corp | Barclays Bank | 5.081 | (306) | Repligen Corp | Barclays Bank | (6.232) |
| (163) | Pool Corp | BNP Paribas | 2.346 | (315) | Republic Services Inc | Goldman Sachs | (5.196) |
| (270) | PPG Industries Inc | HSBC | 3.004 | (953) | Republic Services Inc | Bank of America | 1.811 |
| (443) | PPG Industries Inc | Merrill Lynch | 134 | (1.286) | Republic Services Inc | Merrill Lynch | 1.439 |
| (75) | PPG Industries Inc | Barclays Bank | 1.060 | (84) | Republic Services Inc | BNP Paribas | 7.394 |
| (122) | PPG Industries Inc | Citibank | (698) | (2.430) | Republic Services Inc | Citibank | (83) |
| 50 | Procter & Gamble Co | Goldman Sachs | (5.498) | (88) | Republic Services Inc | Goldman Sachs | 13.972 |
| 848 | Procter & Gamble Co | Merrill Lynch | (30.419) | 124 | ResMed Inc | HSBC | 333 |
| 2.179 | Procter & Gamble Co | Barclays Bank | (427) | 77 | ResMed Inc | Goldman Sachs | (2.961) |
| 60 | Procter & Gamble Co | BNP Paribas | (22.252) | (120) | Revvity Inc | JP Morgan | (1.855) |
| 1.594 | Procter & Gamble Co | Goldman Sachs | 717 | (2.001) | Revvity Inc | Bank of America | 13 |
| (172) | Progressive Corp | Merrill Lynch | 5.992 | (1.717) | Revvity Inc | Merrill Lynch | 10.225 |
| (1.004) | Progressive Corp | Barclays Bank | 9.666 | (165) | Revvity Inc | Barclays Bank | 189 |
| (2.318) | Progressive Corp | BNP Paribas | 2.574 | | | HSBC | 2.124 |
| (330) | Progressive Corp | Goldman Sachs | 3.248 | | | | |
| (779) | Progressive Corp | HSBC | 4.776 | | | | |
| (763) | Progressive Corp | Barclays Bank | 291 | | | | |
| (179) | PTC Inc | BNP Paribas | (205) | | | | |
| (88) | PTC Inc | Goldman Sachs | 1.349 | | | | |
| (423) | Public Service Enterprise Group Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.120) | Rivian Automotive Inc 'A' | Bank of America | | (151) | Sempra Energy | BNP Paribas | 1.089 |
| | | Merrill Lynch | (1.773) | (1.113) | Sensata Technologies Holding Plc | Barclays Bank | (106) |
| (3.848) | Rivian Automotive Inc 'A' | BNP Paribas | (4.925) | (475) | Sensata Technologies Holding Plc | Goldman Sachs | (406) |
| (1.937) | Rivian Automotive Inc 'A' | Citibank | (949) | 85 | ServiceNow Inc | Bank of America | |
| (2.005) | Rivian Automotive Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.566) | | | Merrill Lynch | 6.987 |
| (131) | Robert Half International Inc | Barclays Bank | 367 | 644 | ServiceNow Inc | Barclays Bank | 21.864 |
| (129) | Robert Half International Inc | Citibank | 361 | 13 | ServiceNow Inc | Goldman Sachs | 1.069 |
| (221) | ROBLOX Corp 'A' | BNP Paribas | (309) | 66 | ServiceNow Inc | HSBC | 7.019 |
| (363) | ROBLOX Corp 'A' | Goldman Sachs | (508) | (476) | Sherwin-Williams Co | Barclays Bank | 2.099 |
| 37 | Rockwell Automation Inc | Barclays Bank | (36) | (199) | Sherwin-Williams Co | BNP Paribas | 74 |
| 87 | Rockwell Automation Inc | Goldman Sachs | 639 | (183) | Sherwin-Williams Co | Goldman Sachs | 68 |
| 64 | Rockwell Automation Inc | JP Morgan | 238 | (301) | Sherwin-Williams Co | HSBC | 1.415 |
| 189 | Roku Inc | Goldman Sachs | 620 | (71) | Sherwin-Williams Co | JP Morgan | 334 |
| 298 | Roku Inc | HSBC | 558 | 13.448 | Sirius XM Holdings Inc | Barclays Bank | 672 |
| 2.829 | Rollins Inc | Bank of America | | (75) | Skyworks Solutions Inc | Goldman Sachs | (361) |
| | | Merrill Lynch | (9.435) | (237) | Skyworks Solutions Inc | HSBC | 223 |
| 543 | Rollins Inc | Barclays Bank | (920) | (552) | Snap Inc 'A' | Bank of America | |
| 389 | Rollins Inc | BNP Paribas | (1.297) | (4.502) | Snap Inc 'A' | Merrill Lynch | (707) |
| 990 | Rollins Inc | Citibank | (1.678) | (1.879) | Snap Inc 'A' | Barclays Bank | (286) |
| 1.200 | Rollins Inc | Goldman Sachs | (4.002) | (844) | Snap Inc 'A' | BNP Paribas | (2.405) |
| 239 | Rollins Inc | HSBC | (639) | 203 | Snap-on Inc | Goldman Sachs | (1.080) |
| (79) | Roper Technologies Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 778 | 419 | Snap-on Inc | Merrill Lynch | (983) |
| (104) | Roper Technologies Inc | Barclays Bank | 74 | 403 | Snap-on Inc | Barclays Bank | (3.507) |
| (339) | Roper Technologies Inc | BNP Paribas | 3.339 | 60 | Snap-on Inc | BNP Paribas | (1.951) |
| (298) | Roper Technologies Inc | Citibank | 618 | 165 | Snap-on Inc | Citibank | (502) |
| (143) | Roper Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.409 | 192 | Snap-on Inc | Goldman Sachs | (799) |
| (343) | Roper Technologies Inc | HSBC | 2.133 | 44 | Snap-on Inc | HSBC | (1.332) |
| (652) | Ross Stores Inc | Barclays Bank | 1.408 | (411) | Snowflake Inc 'A' | JP Morgan | (305) |
| (269) | Ross Stores Inc | BNP Paribas | 519 | (508) | Snowflake Inc 'A' | Barclays Bank | 2.085 |
| (45) | Ross Stores Inc | HSBC | 107 | (114) | Snowflake Inc 'A' | BNP Paribas | 3.327 |
| (562) | Royalty Pharma Plc 'A' | Barclays Bank | 410 | (133) | Snowflake Inc 'A' | Citibank | (782) |
| (454) | Royalty Pharma Plc 'A' | BNP Paribas | 763 | (160) | Snowflake Inc 'A' | Goldman Sachs | 871 |
| (2.529) | Royalty Pharma Plc 'A' | Goldman Sachs | 4.249 | (56) | SolarEdge Technologies Inc | HSBC | (813) |
| (2.182) | RPM International Inc | Barclays Bank | 44 | (462) | SolarEdge Technologies Inc | Barclays Bank | 625 |
| (412) | RPM International Inc | BNP Paribas | 416 | (82) | SolarEdge Technologies Inc | BNP Paribas | 9.060 |
| (758) | RPM International Inc | Goldman Sachs | 766 | (178) | SolarEdge Technologies Inc | Citibank | 674 |
| (245) | RPM International Inc | HSBC | 196 | (93) | SolarEdge Technologies Inc | Goldman Sachs | 3.491 |
| 38 | S&P Global Inc | Citibank | (399) | (66) | SolarEdge Technologies Inc | HSBC | 369 |
| 36 | S&P Global Inc | JP Morgan | 240 | (709) | Southwest Airlines Co | JP Morgan | 262 |
| (596) | Salesforce Inc | Barclays Bank | (4.905) | (2.363) | Southwest Airlines Co | Bank of America | |
| (957) | Salesforce Inc | BNP Paribas | (16.317) | (2.143) | Southwest Airlines Co | Merrill Lynch | (603) |
| (37) | Salesforce Inc | HSBC | (832) | (3.029) | Southwest Airlines Co | Barclays Bank | (1.164) |
| (1.269) | Schlumberger NV | Barclays Bank | 2.757 | (1.751) | Southwest Airlines Co | BNP Paribas | (1.822) |
| (1.008) | Schlumberger NV | Citibank | 2.642 | (38.622) | Spectrum Brands Holdings Inc | Citibank | (1.927) |
| (1.559) | Sea Ltd ADR | Barclays Bank | 6.562 | 1.192 | Splunk Inc | Goldman Sachs | (1.488) |
| (2.607) | Sea Ltd ADR | BNP Paribas | 78.419 | 1.105 | Splunk Inc | JP Morgan | 43.257 |
| (15) | Sea Ltd ADR | Goldman Sachs | 373 | 279 | Splunk Inc | Barclays Bank | 426 |
| (536) | Seagate Technology Holdings Plc | Barclays Bank | 2.080 | 237 | Splunk Inc | BNP Paribas | 11.370 |
| (575) | Seagate Technology Holdings Plc | BNP Paribas | 1.144 | 486 | Splunk Inc | Citibank | 47 |
| (398) | Seagate Technology Holdings Plc | Citibank | 575 | 174 | SS&C Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.439 |
| (236) | Seagate Technology Holdings Plc | Goldman Sachs | 470 | (286) | Stanley Black & Decker Inc | HSBC | 6.435 |
| (916) | Sealed Air Corp | Bank of America | | (2.055) | Stanley Black & Decker Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 4.030 | (1.021) | Stanley Black & Decker Inc | Merrill Lynch | 666 |
| (695) | Sealed Air Corp | BNP Paribas | 3.058 | (119) | Stanley Black & Decker Inc | Barclays Bank | 10.254 |
| (249) | Sealed Air Corp | Citibank | 309 | (662) | Stanley Black & Decker Inc | BNP Paribas | 2.379 |
| (633) | Sealed Air Corp | Goldman Sachs | 2.785 | (189) | Stanley Black & Decker Inc | Citibank | 594 |
| (426) | Sealed Air Corp | HSBC | 2.126 | 1.439 | Starbucks Corp | Goldman Sachs | 1.542 |
| 242 | SEI Investments Co | Bank of America | | 974 | Starbucks Corp | HSBC | 1.408 |
| | | Merrill Lynch | (407) | 1.838 | Starbucks Corp | Barclays Bank | (8.073) |
| 405 | SEI Investments Co | Barclays Bank | (421) | 529 | Starbucks Corp | BNP Paribas | (9.107) |
| 174 | SEI Investments Co | Goldman Sachs | (292) | 431 | Starbucks Corp | Citibank | (6.928) |
| 377 | SEI Investments Co | HSBC | (780) | 205 | Starbucks Corp | Goldman Sachs | (4.946) |
| (66) | Sempra Energy | Barclays Bank | 182 | | | HSBC | (4.258) |
| | | | | | | JP Morgan | (2.025) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 522 | State Street Corp | Bank of America | | (30) | Teledyne Technologies Inc | Citibank | 881 |
| | | Merrill Lynch | 251 | (273) | Teledyne Technologies Inc | Goldman Sachs | 6.314 |
| 668 | State Street Corp | Barclays Bank | (13) | (92) | Teledyne Technologies Inc | HSBC | 2.016 |
| 46 | State Street Corp | Goldman Sachs | 22 | (206) | Teleflex Inc | Bank of America | |
| 316 | State Street Corp | HSBC | (186) | | | Merrill Lynch | 3.383 |
| 193 | Steel Dynamics Inc | Barclays Bank | (368) | (421) | Teleflex Inc | Barclays Bank | 5.662 |
| 2.203 | Steel Dynamics Inc | BNP Paribas | (15.179) | (66) | Teleflex Inc | BNP Paribas | 1.084 |
| (285) | STERIS Plc | Barclays Bank | 2.579 | (254) | Teleflex Inc | Goldman Sachs | 4.171 |
| (313) | STERIS Plc | BNP Paribas | 4.056 | (150) | Teleflex Inc | HSBC | 4.093 |
| (416) | STERIS Plc | Goldman Sachs | 5.391 | (95) | Teleflex Inc | JP Morgan | 2.593 |
| (188) | STERIS Plc | HSBC | (1.671) | 156 | Teradyne Inc | Barclays Bank | 593 |
| 83 | Stryker Corp | Bank of America | | 222 | Teradyne Inc | Citibank | 258 |
| | | Merrill Lynch | (1.576) | (356) | Tesla Inc | Bank of America | |
| 210 | Stryker Corp | Citibank | (3.410) | | | Merrill Lynch | (11.997) |
| 207 | Stryker Corp | Goldman Sachs | (3.931) | (326) | Tesla Inc | BNP Paribas | (10.986) |
| 16 | Stryker Corp | JP Morgan | (293) | (203) | Tesla Inc | Citibank | (2.270) |
| 654 | Synchrony Financial | Bank of America | | (163) | Tesla Inc | Goldman Sachs | (5.493) |
| | | Merrill Lynch | 2.040 | (86) | Tesla Inc | HSBC | (2.430) |
| 273 | Synchrony Financial | Barclays Bank | 202 | 81 | Texas Instruments Inc | Bank of America | |
| 529 | Synchrony Financial | BNP Paribas | 1.650 | | | Merrill Lynch | 756 |
| 977 | Synchrony Financial | Citibank | 723 | 481 | Texas Instruments Inc | Barclays Bank | 1.794 |
| 232 | Synchrony Financial | Goldman Sachs | 724 | 214 | Texas Instruments Inc | BNP Paribas | 1.997 |
| 442 | Synchrony Financial | HSBC | 1.631 | 167 | Texas Instruments Inc | Citibank | 623 |
| 136 | Synchrony Financial | JP Morgan | 502 | 562 | Texas Instruments Inc | Goldman Sachs | 5.243 |
| 193 | Synopsys Inc | Bank of America | | 57 | Texas Instruments Inc | JP Morgan | 591 |
| | | Merrill Lynch | 16.787 | (57) | Thermo Fisher Scientific Inc | Bank of America | |
| 219 | Synopsys Inc | Barclays Bank | 11.691 | | | Merrill Lynch | 1.164 |
| 1.228 | Synopsys Inc | Citibank | 71.936 | (540) | Thermo Fisher Scientific Inc | Barclays Bank | 11.382 |
| 64 | Synopsys Inc | Goldman Sachs | 5.567 | (48) | Thermo Fisher Scientific Inc | BNP Paribas | 980 |
| 89 | Synopsys Inc | HSBC | 7.878 | (47) | Thermo Fisher Scientific Inc | Citibank | 1.211 |
| (772) | Sysco Corp | Barclays Bank | 1.389 | (76) | Thermo Fisher Scientific Inc | Goldman Sachs | 1.552 |
| (873) | Sysco Corp | BNP Paribas | 4.077 | (56) | Thermo Fisher Scientific Inc | HSBC | 2.202 |
| (834) | Sysco Corp | Citibank | 875 | (17) | Thermo Fisher Scientific Inc | JP Morgan | 668 |
| (954) | Sysco Corp | Goldman Sachs | 4.455 | 135 | TJX Cos Inc | Bank of America | |
| (762) | Sysco Corp | HSBC | 4.801 | | | Merrill Lynch | (424) |
| (159) | Sysco Corp | JP Morgan | 1.002 | 760 | TJX Cos Inc | Barclays Bank | (1.557) |
| (121) | T Rowe Price Group Inc | Barclays Bank | (496) | 307 | TJX Cos Inc | BNP Paribas | (964) |
| (146) | Take-Two Interactive Software Inc | Bank of America | | 726 | TJX Cos Inc | Citibank | (239) |
| | | Merrill Lynch | (1.851) | 544 | TJX Cos Inc | Goldman Sachs | (1.708) |
| (2.446) | Take-Two Interactive Software Inc | Barclays Bank | (703) | 542 | TJX Cos Inc | HSBC | (1.220) |
| (763) | Take-Two Interactive Software Inc | BNP Paribas | (9.675) | 134 | TJX Cos Inc | JP Morgan | (302) |
| (582) | Take-Two Interactive Software Inc | Citibank | (410) | (267) | T-Mobile US Inc | Bank of America | |
| (934) | Take-Two Interactive Software Inc | Goldman Sachs | (11.843) | | | Merrill Lynch | 1.866 |
| (184) | Take-Two Interactive Software Inc | HSBC | (2.219) | (393) | T-Mobile US Inc | Barclays Bank | 1.560 |
| (650) | Targa Resources Corp | Bank of America | | (1.178) | T-Mobile US Inc | BNP Paribas | 8.234 |
| | | Merrill Lynch | 1.937 | (1.247) | T-Mobile US Inc | Goldman Sachs | 8.717 |
| (1.726) | Targa Resources Corp | Barclays Bank | 5.049 | (521) | T-Mobile US Inc | HSBC | 3.413 |
| (1.537) | Targa Resources Corp | BNP Paribas | 4.580 | (597) | Toast Inc 'A' | Bank of America | |
| (1.183) | Targa Resources Corp | Goldman Sachs | 3.525 | | | Merrill Lynch | (1.319) |
| (152) | Targa Resources Corp | HSBC | 524 | (4.444) | Toast Inc 'A' | Barclays Bank | (1.511) |
| (74) | Target Corp | Bank of America | | (289) | Toast Inc 'A' | BNP Paribas | (639) |
| | | Merrill Lynch | 1.974 | (547) | Toast Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.209) |
| (530) | Target Corp | Barclays Bank | 6.955 | 1.013 | Toro Co | BNP Paribas | (6.696) |
| (127) | Target Corp | Citibank | 2.289 | (326) | Tractor Supply Co | Barclays Bank | 3.069 |
| (501) | Target Corp | Goldman Sachs | 13.367 | (93) | Tractor Supply Co | BNP Paribas | 1.861 |
| (545) | TE Connectivity Ltd | Barclays Bank | 1.150 | (101) | Tractor Supply Co | Citibank | 201 |
| (286) | TE Connectivity Ltd | BNP Paribas | (146) | (58) | Tractor Supply Co | Goldman Sachs | 1.161 |
| (1.001) | TE Connectivity Ltd | Citibank | 2.112 | (165) | Trade Desk Inc 'A' | Bank of America | |
| (167) | TE Connectivity Ltd | Goldman Sachs | (85) | | | Merrill Lynch | (954) |
| (89) | TE Connectivity Ltd | HSBC | (114) | (463) | Trade Desk Inc 'A' | HSBC | (2.357) |
| (119) | Teledyne Technologies Inc | Bank of America | | (422) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.351 |
| | | Merrill Lynch | 2.752 | (69) | Trane Technologies Plc | Barclays Bank | 166 |
| (629) | Teledyne Technologies Inc | Barclays Bank | 18.474 | (213) | Trane Technologies Plc | Citibank | 1.056 |
| (449) | Teledyne Technologies Inc | BNP Paribas | 10.385 | (145) | TransUnion | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (508) |
| | | | | (186) | TransUnion | Barclays Bank | 7 |
| | | | | (1.751) | TransUnion | BNP Paribas | (6.129) |
| | | | | (551) | TransUnion | Goldman Sachs | (1.929) |
| | | | | (218) | TransUnion | HSBC | (1.537) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------------|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (288) | Travelers Cos Inc | HSBC | 3.168 | (373) | US Bancorp | Bank of America | |
| 1.209 | Trimble Inc | BNP Paribas | (762) | | | Merrill Lynch | (190) |
| (359) | Truist Financial Corp | Barclays Bank | (29) | (1.065) | US Bancorp | Barclays Bank | 665 |
| (953) | Truist Financial Corp | BNP Paribas | (2.659) | (1.243) | US Bancorp | BNP Paribas | (634) |
| (709) | Truist Financial Corp | Goldman Sachs | (1.978) | (338) | US Bancorp | Citibank | 116 |
| (894) | Truist Financial Corp | HSBC | (1.708) | (1.316) | US Bancorp | Goldman Sachs | (671) |
| (208) | Twilio Inc 'A' | Bank of America | | (278) | US Bancorp | HSBC | (117) |
| | | Merrill Lynch | (4.039) | (56) | Vail Resorts Inc | BNP Paribas | 152 |
| (223) | Twilio Inc 'A' | Barclays Bank | (2.027) | (160) | Vail Resorts Inc | Goldman Sachs | 434 |
| (1.438) | Twilio Inc 'A' | BNP Paribas | (27.926) | (163) | Valero Energy Corp | BNP Paribas | 800 |
| (1.441) | Twilio Inc 'A' | Goldman Sachs | (27.984) | (80) | Valero Energy Corp | Goldman Sachs | 393 |
| (167) | Twilio Inc 'A' | HSBC | (1.997) | 56 | Veeva Systems Inc 'A' | Bank of America | |
| (1) | Tyler Technologies Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (637) |
| | | Merrill Lynch | (4) | 703 | Veeva Systems Inc 'A' | Barclays Bank | (105) |
| (693) | Tyler Technologies Inc | Barclays Bank | 499 | 104 | Veeva Systems Inc 'A' | BNP Paribas | (1.182) |
| (398) | Tyler Technologies Inc | BNP Paribas | (1.401) | 144 | Veeva Systems Inc 'A' | Citibank | (22) |
| (30) | Tyler Technologies Inc [†] | Citibank | — | 305 | Veeva Systems Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.468) |
| (308) | Tyler Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.084) | 162 | Veeva Systems Inc 'A' | HSBC | (1.996) |
| (967) | Tyson Foods Inc 'A' | Bank of America | | 240 | Veeva Systems Inc 'A' | JP Morgan | (2.957) |
| | | Merrill Lynch | (1.557) | 187 | VeriSign Inc | Bank of America | |
| (2.069) | Tyson Foods Inc 'A' | Barclays Bank | 881 | | | Merrill Lynch | (264) |
| (894) | Tyson Foods Inc 'A' | BNP Paribas | (1.439) | 1.591 | VeriSign Inc | Barclays Bank | (4.808) |
| (5.199) | Tyson Foods Inc 'A' | Citibank | (2.978) | 584 | VeriSign Inc | BNP Paribas | (823) |
| (513) | Uber Technologies Inc | Barclays Bank | (214) | 174 | VeriSign Inc | Citibank | (133) |
| 568 | UGI Corp | Bank of America | | 1.017 | VeriSign Inc | Goldman Sachs | (1.434) |
| | | Merrill Lynch | (358) | 176 | VeriSign Inc | HSBC | 847 |
| 719 | UGI Corp | Barclays Bank | (518) | 132 | VeriSign Inc | JP Morgan | 635 |
| 5.093 | UGI Corp | BNP Paribas | (3.209) | 60 | Verisk Analytics Inc | Barclays Bank | (8) |
| 1.952 | UGI Corp | Goldman Sachs | (1.230) | 166 | Verisk Analytics Inc | BNP Paribas | 518 |
| 497 | UGI Corp | JP Morgan | (1.223) | 56 | Verisk Analytics Inc | HSBC | 447 |
| 1.027 | U-Haul Holding Co | Barclays Bank | (8.945) | (2.118) | Verizon Communications Inc | Bank of America | |
| 61 | U-Haul Holding Co | BNP Paribas | (246) | | | Merrill Lynch | 3.156 |
| 333 | U-Haul Holding Co | Goldman Sachs | (1.345) | (627) | Verizon Communications Inc | Barclays Bank | 426 |
| 8 | Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc | Bank of America | | (2.925) | Verizon Communications Inc | BNP Paribas | 4.358 |
| | | Merrill Lynch | (803) | (934) | Verizon Communications Inc | Citibank | 635 |
| 330 | Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc | Barclays Bank | (21.496) | (2.839) | Verizon Communications Inc | Goldman Sachs | 4.230 |
| 12 | Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc | BNP Paribas | (1.205) | (1.232) | Verizon Communications Inc | HSBC | 3.142 |
| 127 | Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc | Goldman Sachs | (12.755) | 104 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| (304) | Union Pacific Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.548) |
| | | Merrill Lynch | 2.088 | 444 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Barclays Bank | (4.297) |
| (667) | Union Pacific Corp | Barclays Bank | 2.042 | 657 | Vertex Pharmaceuticals Inc | BNP Paribas | (16.097) |
| (772) | Union Pacific Corp | BNP Paribas | 5.304 | 171 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Citibank | (2.522) |
| (815) | Union Pacific Corp | Citibank | 2.419 | 110 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (2.695) |
| (391) | Union Pacific Corp | Goldman Sachs | 2.686 | 309 | Vertex Pharmaceuticals Inc | HSBC | (6.161) |
| (133) | Union Pacific Corp | HSBC | 954 | (445) | VF Corp | Bank of America | |
| 171 | United Parcel Service Inc 'B' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.940 |
| | | Merrill Lynch | (233) | (2.548) | VF Corp | Barclays Bank | 1.569 |
| 74 | United Parcel Service Inc 'B' | Barclays Bank | (297) | (907) | VF Corp | BNP Paribas | 3.955 |
| 149 | United Parcel Service Inc 'B' | BNP Paribas | (203) | (820) | VF Corp | Goldman Sachs | 3.575 |
| 106 | United Parcel Service Inc 'B' | Citibank | (426) | 1.022 | Viatis Inc | Barclays Bank | (368) |
| 1.496 | United Parcel Service Inc 'B' | Goldman Sachs | (2.035) | 1.071 | Visa Inc 'A' | Barclays Bank | (10.444) |
| 368 | United Parcel Service Inc 'B' | HSBC | (2.539) | 126 | Visa Inc 'A' | BNP Paribas | (1.952) |
| 203 | United Parcel Service Inc 'B' | JP Morgan | (1.401) | 73 | Visa Inc 'A' | Citibank | (1.019) |
| 119 | United Rentals Inc | BNP Paribas | 176 | 210 | Visa Inc 'A' | JP Morgan | (3.131) |
| 190 | United Rentals Inc | HSBC | (471) | (466) | Vulcan Materials Co | Barclays Bank | 1.118 |
| (141) | United Therapeutics Corp | BNP Paribas | 795 | (81) | Vulcan Materials Co | Citibank | 194 |
| (174) | United Therapeutics Corp | JP Morgan | 296 | (27) | Vulcan Materials Co | HSBC | (55) |
| (71) | UnitedHealth Group Inc | Barclays Bank | 144 | (1.079) | W R Berkley Corp | Bank of America | |
| (104) | UnitedHealth Group Inc | Citibank | 211 | | | Merrill Lynch | 2.892 |
| (58) | UnitedHealth Group Inc | Goldman Sachs | 480 | (672) | W R Berkley Corp | Barclays Bank | 1.364 |
| (25) | UnitedHealth Group Inc | HSBC | 351 | (1.104) | W R Berkley Corp | BNP Paribas | 2.959 |
| (2.365) | Unity Software Inc | Barclays Bank | 2.152 | (780) | W R Berkley Corp | Goldman Sachs | 2.090 |
| (1.099) | Unity Software Inc | BNP Paribas | 824 | (938) | W R Berkley Corp | HSBC | 2.223 |
| (1.048) | Unity Software Inc | Citibank | (1.486) | (965) | Walgreens Boots Alliance Inc | Barclays Bank | 51 |
| 149 | Universal Health Services Inc 'B' | BNP Paribas | (1.287) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.133) | Walgreens Boots Alliance Inc | Citibank | 888 | 150 | Westlake Corp | Bank of America | |
| 260 | Walmart Inc | Barclays Bank | (384) | | | Merrill Lynch | (1.469) |
| 231 | Walmart Inc | BNP Paribas | (1.545) | 333 | Westlake Corp | Barclays Bank | (1.769) |
| 184 | Walmart Inc | Citibank | (405) | 866 | Westlake Corp | BNP Paribas | (8.478) |
| 700 | Walmart Inc | JP Morgan | (5.271) | 472 | Westlake Corp | Citibank | (4.552) |
| (37) | Walt Disney Co | Bank of America | | 85 | Westlake Corp | Goldman Sachs | (832) |
| | | Merrill Lynch | 195 | 88 | Westlake Corp | JP Morgan | (1.155) |
| (300) | Walt Disney Co | Barclays Bank | 1.269 | (1.805) | Westrock Co | HSBC | 271 |
| (1.715) | Walt Disney Co | BNP Paribas | 9.038 | 1.084 | Whirlpool Corp | Barclays Bank | (2.862) |
| (415) | Walt Disney Co | HSBC | 6.383 | 196 | Whirlpool Corp | BNP Paribas | (490) |
| (2.219) | Warner Bros Discovery Inc | Bank of America | | (2.447) | Williams Cos Inc | Barclays Bank | 896 |
| | | Merrill Lynch | 3.018 | (6.917) | Williams Cos Inc | BNP Paribas | 4.289 |
| (4.083) | Warner Bros Discovery Inc | Barclays Bank | 2.899 | (344) | Williams Cos Inc | Citibank | 90 |
| (5.762) | Warner Bros Discovery Inc | BNP Paribas | 7.836 | (3.821) | Williams Cos Inc | Goldman Sachs | 2.369 |
| (5.188) | Warner Bros Discovery Inc | Goldman Sachs | 7.056 | (509) | Williams Cos Inc | HSBC | 550 |
| (1.157) | Warner Bros Discovery Inc | JP Morgan | 2.326 | (116) | Willis Towers Watson Plc | BNP Paribas | 1.353 |
| (87) | Waste Connections Inc | Bank of America | | (297) | Wix.com Ltd | Barclays Bank | 927 |
| | | Merrill Lynch | 567 | (283) | Wolfspeed Inc | Bank of America | |
| (1.592) | Waste Connections Inc | Barclays Bank | 3.502 | | | Merrill Lynch | (1.869) |
| (947) | Waste Connections Inc | BNP Paribas | 6.174 | (1.537) | Wolfspeed Inc | Barclays Bank | (3.435) |
| (207) | Waste Connections Inc | Citibank | 455 | (1.005) | Wolfspeed Inc | BNP Paribas | (6.638) |
| (729) | Waste Connections Inc | Goldman Sachs | 4.753 | (756) | Wolfspeed Inc | Citibank | (1.690) |
| (220) | Waste Connections Inc | HSBC | 1.058 | (2.887) | Wolfspeed Inc | Goldman Sachs | (19.069) |
| (1.909) | Waste Management Inc | Bank of America | | (293) | Wolfspeed Inc | HSBC | (2.126) |
| | | Merrill Lynch | 12.237 | (158) | Wolfspeed Inc | JP Morgan | (1.146) |
| (437) | Waste Management Inc | Barclays Bank | 608 | 280 | Workday Inc 'A' | Barclays Bank | 3.483 |
| (539) | Waste Management Inc | BNP Paribas | 3.455 | 397 | Workday Inc 'A' | BNP Paribas | 9.286 |
| (213) | Waste Management Inc | Citibank | 1 | 545 | Workday Inc 'A' | Goldman Sachs | 12.748 |
| (652) | Waste Management Inc | Goldman Sachs | 4.179 | 236 | Workday Inc 'A' | HSBC | 6.903 |
| (603) | Waste Management Inc | HSBC | 4.137 | 174 | WW Grainger Inc | Barclays Bank | (1.853) |
| 33 | Waters Corp | Bank of America | | 23 | WW Grainger Inc | BNP Paribas | (472) |
| | | Merrill Lynch | (751) | 19 | WW Grainger Inc | Citibank | (127) |
| 740 | Waters Corp | Barclays Bank | (12.772) | 25 | WW Grainger Inc | Goldman Sachs | (513) |
| 69 | Waters Corp | BNP Paribas | (1.570) | 388 | WW Grainger Inc | HSBC | (11.004) |
| 302 | Waters Corp | Goldman Sachs | (6.871) | 12 | WW Grainger Inc | JP Morgan | (340) |
| 193 | Waters Corp | HSBC | (8.868) | (671) | Wynn Resorts Ltd | Barclays Bank | 7.314 |
| (552) | Webster Financial Corp | Bank of America | | (411) | Wynn Resorts Ltd | BNP Paribas | 3.370 |
| | | Merrill Lynch | (1.430) | (440) | Wynn Resorts Ltd | Goldman Sachs | 3.608 |
| (725) | Webster Financial Corp | Barclays Bank | 397 | (93) | Wynn Resorts Ltd | JP Morgan | 1.418 |
| (262) | Webster Financial Corp | BNP Paribas | (679) | 143 | Xylem Inc | Bank of America | |
| (834) | Webster Financial Corp | Citibank | 854 | | | Merrill Lynch | (569) |
| (260) | Webster Financial Corp | HSBC | (725) | 978 | Xylem Inc | Barclays Bank | (2.571) |
| (1.634) | Wells Fargo & Co | Barclays Bank | 1.585 | 221 | Xylem Inc | BNP Paribas | (880) |
| 117 | West Pharmaceutical Services Inc | Barclays Bank | (2.221) | 343 | Xylem Inc | Citibank | (424) |
| 56 | West Pharmaceutical Services Inc | BNP Paribas | (1.301) | 225 | Xylem Inc | JP Morgan | (1.435) |
| 61 | West Pharmaceutical Services Inc | Goldman Sachs | (1.418) | 3.107 | Yum! Brands Inc | Barclays Bank | (23.458) |
| 7 | West Pharmaceutical Services Inc | HSBC | (246) | 1.157 | Yum! Brands Inc | BNP Paribas | (12.056) |
| (1.004) | Western Digital Corp | Bank of America | | 1.404 | Yum! Brands Inc | Citibank | (9.007) |
| | | Merrill Lynch | (2.159) | 2.121 | Yum! Brands Inc | Goldman Sachs | (22.101) |
| (159) | Western Digital Corp | Barclays Bank | (84) | 206 | Yum! Brands Inc | HSBC | (1.889) |
| (1.435) | Western Digital Corp | BNP Paribas | (3.085) | 274 | Yum! Brands Inc | JP Morgan | (2.513) |
| (230) | Western Digital Corp | Citibank | (122) | (34) | Zebra Technologies Corp 'A' | Bank of America | |
| (247) | Western Digital Corp | Goldman Sachs | (531) | | | Merrill Lynch | 270 |
| (460) | Western Digital Corp | HSBC | (2.171) | (37) | Zebra Technologies Corp 'A' | Barclays Bank | (51) |
| 723 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Bank of America | | (86) | Zebra Technologies Corp 'A' | BNP Paribas | 684 |
| | | Merrill Lynch | (4.150) | (175) | Zebra Technologies Corp 'A' | Citibank | 890 |
| 660 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Barclays Bank | (3.749) | (152) | Zebra Technologies Corp 'A' | Goldman Sachs | 1.208 |
| 1.703 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | BNP Paribas | (9.775) | (30) | Zebra Technologies Corp 'A' | HSBC | 453 |
| 393 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Goldman Sachs | (2.256) | (455) | Zillow Group Inc 'C' | Bank of America | |
| 435 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | HSBC | (2.941) | | | Merrill Lynch | 150 |
| | | | | (242) | Zillow Group Inc 'C' | BNP Paribas | 80 |
| | | | | (234) | Zillow Group Inc 'C' | Goldman Sachs | 77 |
| | | | | 552 | Zimmer Biomet Holdings Inc | Barclays Bank | (5.702) |
| | | | | 163 | Zimmer Biomet Holdings Inc | BNP Paribas | (1.936) |
| | | | | 67 | Zimmer Biomet Holdings Inc | HSBC | (838) |
| | | | | 106 | Zoetis Inc | BNP Paribas | (2.549) |
| | | | | 80 | Zoetis Inc | Goldman Sachs | (1.924) |
| | | | | 216 | Zoetis Inc | HSBC | (5.415) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 214 | Zoom Video Communications Inc 'A' | HSBC | 469 |
| (1.461) | ZoomInfo Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (4.697) |
| (751) | ZoomInfo Technologies Inc | Barclays Bank | 199 |
| (6.403) | ZoomInfo Technologies Inc | BNP Paribas | (20.586) |
| (1.761) | ZoomInfo Technologies Inc | Goldman Sachs | (5.662) |
| (116) | Zscaler Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.611) |
| (173) | Zscaler Inc | Barclays Bank | (1.206) |
| | | | 412.849 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 274.989.187) | | | 1.346.272 |
| <small>†† Beträge mit einem Wert unter USD 0,5 wurden auf null abgerundet.</small> | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | USD 1.250.000 | Fund receives Fixed 0,537% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2030 | (232.807) | (232.807) |
| CCIRS | THB 18.644.000 | Fund receives Fixed 2,135% and pays Floating THB 3 Month THOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (3.437) | (3.431) |
| CCIRS | THB 19.272.000 | Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating THB 3 Month THOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 2.212 | 2.218 |
| CCIRS | THB 78.271.000 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating THB 3 Month THOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 25.035 | 25.060 |
| CCIRS | EUR 451.000 | Fund receives Fixed 2,884% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (13) | (1.620) |
| CCIRS | EUR 480.000 | Fund receives Fixed 2,910% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (1.113) | (1.107) |
| CCIRS | EUR 680.000 | Fund receives Fixed 3,018% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 1.644 | 1.981 |
| CCIRS | USD 804.000 | Fund receives Fixed 3,057% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (11.695) | (11.838) |
| CCIRS | EUR 2.424.000 | Fund receives Fixed 3,127% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 28.516 | 19.891 |
| CCIRS | CAD 656.000 | Fund receives Fixed 3,231% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (15.512) | (17.117) |
| CCIRS | SEK 71.084.000 | Fund receives Fixed 3,234% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 98.693 | 69.701 |
| CCIRS | CAD 420.000 | Fund receives Fixed 3,245% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (7.892) | (10.600) |
| CCIRS | USD 486.000 | Fund receives Fixed 3,248% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (3.004) | (2.999) |
| CCIRS | EUR 556.000 | Fund receives Fixed 3,400% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 11.912 | 11.918 |
| CCIRS | USD 80.000 | Fund receives Fixed 3,673% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 1.418 | 1.035 |
| CCIRS | CAD 16.835.000 | Fund receives Fixed 3,734% and pays Floating CAD 3 Month CDOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 71.036 | 77.130 |
| CCIRS | USD 444.000 | Fund receives Fixed 3,744% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 7.494 | 7.158 |
| CCIRS | GBP 9.184.000 | Fund receives Fixed 3,779% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (275.355) | (302.434) |
| CCIRS | GBP 687.000 | Fund receives Fixed 3,817% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (20.484) | (21.214) |
| CCIRS | AUD 383.000 | Fund receives Fixed 3,964% and pays Floating AUD 6 Month BBSW | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (2.797) | (2.793) |
| CCIRS | AUD 124.000 | Fund receives Fixed 4,016% and pays Floating AUD 6 Month BBSW | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (693) | (561) |
| CCIRS | GBP 574.000 | Fund receives Fixed 4,087% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (8.110) | (9.460) |
| CCIRS | AUD 764.000 | Fund receives Fixed 4,118% and pays Floating AUD 6 Month BBSW | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 704 | 695 |
| CCIRS | HKD 37.381.028 | Fund receives Fixed 4,130% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 94.295 | 94.349 |
| CCIRS | HKD 8.460.020 | Fund receives Fixed 4,140% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 21.829 | 21.841 |
| CCIRS | GBP 469.000 | Fund receives Fixed 4,498% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 2.547 | 2.553 |
| CCIRS | ZAR 7.806.000 | Fund receives Fixed 8,355% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (18.123) | (18.118) |
| CCIRS | ZAR 10.331.000 | Fund receives Fixed 8,385% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (23.376) | (23.370) |
| CCIRS | ZAR 7.000.000 | Fund receives Fixed 8,515% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (14.051) | (14.046) |
| CCIRS | ZAR 8.967.000 | Fund receives Fixed 9,360% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (3.107) | (3.102) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Marktwert USD |
|-------------------------------------|-------------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | AUD 690.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,608% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 4.326 | 4.331 |
| CCIRS | AUD 155.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,717% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 536 | 483 |
| CCIRS | AUD 1.396.000 | Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,811% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 654 | 529 |
| CCIRS | CAD 1.540.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,110% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 28.613 | 31.680 |
| CCIRS | CAD 600.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,192% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 8.727 | 10.729 |
| CCIRS | CAD 860.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,620% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 8.651 | 3.301 |
| CCIRS | CAD 30.002.000 | Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 3,690% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 27.925 | 46.272 |
| CCIRS | CNY 2.291.000 | Fund receives Floating CNY 3 Month CNRR and pays Fixed 3,010% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (7.386) | (7.382) |
| CCIRS | EUR 261.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,938% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (471) | (466) |
| CCIRS | EUR 289.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,973% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (1.593) | (1.452) |
| CCIRS | EUR 224.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,016% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (1.999) | (1.995) |
| CCIRS | EUR 398.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,034% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (4.242) | (4.234) |
| CCIRS | EUR 1.275.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,220% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (34.852) | (35.131) |
| CCIRS | GBP 236.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,623% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 9.654 | 10.156 |
| CCIRS | GBP 4.845.500 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,632% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 165.583 | 204.359 |
| CCIRS | GBP 300.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,681% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 11.218 | 11.224 |
| CCIRS | GBP 305.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,886% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 4.745 | 5.290 |
| CCIRS | GBP 255.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 4,186% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (3.061) | (3.055) |
| CCIRS | INR 408.824.890 | Fund receives Floating INR 6 Month MIBOR and pays Fixed 6,665% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (137.462) | (137.407) |
| CCIRS | KRW 1.092.749.000 | Fund receives Floating KRW 3 Month KWDC and pays Fixed 3,032% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 8.579 | 8.588 |
| CCIRS | KRW 36.724.000 | Fund receives Floating KRW 3 Month KWDC and pays Fixed 3,055% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 260 | 260 |
| CCIRS | KRW 668.300.000 | Fund receives Floating KRW 3 Month KWDC and pays Fixed 3,182% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 1.775 | 1.781 |
| CCIRS | MXN 10.532.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,075% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | 3.498 | 3.505 |
| CCIRS | MXN 7.610.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,185% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | 673 | 678 |
| CCIRS | MXN 10.644.000 | Fund receives Floating MXN 1 Month TIIE and pays Fixed 8,880% | Bank of America Merrill Lynch | 13/9/2028 | (15.452) | (15.445) |
| CCIRS | PLN 7.465.196 | Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 5,878% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (48.414) | (48.395) |
| CCIRS | SEK 32.360.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 3,244% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | (108.946) | (94.327) |
| CCIRS | SEK 8.931.000 | Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 3,357% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | (17.309) | (13.340) |
| CCIRS | SGD 48.000 | Fund receives Floating SGD 6 Month SORA and pays Fixed 2,880% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2028 | 6 | 7 |
| CCIRS | USD 1.250.000 | Fund receives Floating USD 12 Month FEDL and pays Fixed 0,555% | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2030 | (10.057) | 230.616 |
| CCIRS | USD 424.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,032% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 10.104 | 10.112 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD | Marktwert USD |
|--|-------------------|--|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | USD 212.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,132% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 3.236 | 3.282 |
| CCIRS | USD 433.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,269% | Bank of America Merrill Lynch | 20/9/2033 | 1.755 | 1.763 |
| TRS | KRW 1.046.384.625 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (41.714) | (41.714) |
| TRS | KRW 3.297.789.900 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (133.328) | (133.328) |
| TRS | KRW 1.008.923.175 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (69.939) | (69.939) |
| TRS | KRW 468.893.700 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (29.841) | (29.841) |
| TRS | KRW 237.493.125 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (12.625) | (12.625) |
| TRS | KRW 248.125.350 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (4.615) | (4.615) |
| TRS | KRW 573.010.375 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (15.249) | (15.249) |
| TRS | KRW 325.675.400 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (10.039) | (10.039) |
| TRS | KRW 407.094.250 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (12.549) | (12.549) |
| TRS | KRW 1.178.957.500 | Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index Futures | Bank of America Merrill Lynch | 8/6/2023 | (5.683) | (5.683) |
| TRS | BRL 1.457.428 | Fund receives Ibovespa Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 14/6/2023 | 13.663 | 13.663 |
| TRS | BRL 2.166.429 | Fund receives Ibovespa Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 14/6/2023 | 24.379 | 24.379 |
| TRS | BRL 2.339.414 | Fund receives Ibovespa Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 14/6/2023 | (9.706) | (9.706) |
| TRS | THB 117.498.810 | Fund receives SET50 Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 29/6/2023 | (145.155) | (145.155) |
| TRS | THB 90.605.268 | Fund receives SET50 Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 29/6/2023 | (124.545) | (124.545) |
| TRS | THB 7.655.919 | Fund receives SET50 Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 29/6/2023 | (2.816) | (2.816) |
| TRS | TWD 24.633.989 | Fund receives TAIEX Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 56.848 | 56.848 |
| TRS | TWD 43.862.963 | Fund receives TAIEX Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 74.963 | 74.963 |
| TRS | TWD 25.846.400 | Fund receives TAIEX Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 17.392 | 17.392 |
| TRS | TWD 26.187.236 | Fund receives TAIEX Index Futures and pays Fixed 0,000% | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 6.299 | 6.299 |
| TRS | PLN 4.373.880 | Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index Futures | HSBC | 16/6/2023 | (83.382) | (83.382) |
| TRS | PLN 713.172 | Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index Futures | HSBC | 16/6/2023 | (13.094) | (13.094) |
| TRS | PLN 277.593 | Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index Futures | HSBC | 16/6/2023 | (7.044) | (7.044) |
| TRS | PLN 721.209 | Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index Futures | HSBC | 16/6/2023 | (20.250) | (20.250) |
| TRS | PLN 580.751 | Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index Futures | HSBC | 16/6/2023 | 977 | 977 |
| TRS | PLN 506.790 | Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index Futures | HSBC | 16/6/2023 | 1.664 | 1.664 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 123.595.460) | | | | | (910.349) | (660.159) |

CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps

TRS: Gesamtertrag-Swaps

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement USD | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (29) | EUR | Amsterdam Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 4.664.220 | 38.984 |
| (25) | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.942.286 | (15.740) |
| 78 | EUR | CAC 40 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 5.934.852 | (150.772) |
| (246) | CAD | Canadian 10 Year Bond Futures September 2023 | September 2023 | 22.236.717 | 21.974 |
| (20) | EUR | DAX Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 8.427.749 | 14.521 |
| 15 | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 3.145.500 | 48.065 |
| (89) | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 12.896.485 | (118.090) |
| (75) | GBP | FTSE 100 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 6.951.115 | 263.205 |
| 122 | USD | FTSE China A50 Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.495.842 | (33.327) |
| 84 | EUR | FTSE MIB Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 11.774.184 | (242.577) |
| 17 | ZAR | FTSE/JSE Top 40 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 607.428 | 7.596 |
| (43) | EUR | IBEX 35 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 4.178.105 | 43.004 |
| (15) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 15.902.686 | (87.340) |
| (66) | USD | MSCI Hong Kong Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 3.930.960 | 312.183 |
| (11) | SGD | MSCI Singapore Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 231.042 | 4.266 |
| (54) | SEK | OMX Stockholm 30 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.118.050 | 4.996 |
| (30) | CAD | S&P/TSX 60 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 5.200.690 | 106.717 |
| (36) | USD | SGX NIFTY 50 Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.343.808 | (12.328) |
| (6) | AUD | SPI 200 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 690.014 | 10.118 |
| 6 | CHF | Swiss Market Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 742.431 | (3.523) |
| 124 | JPY | Topix Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 18.808.119 | 1.209.842 |
| 210 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 25.078.235 | 282.167 |
| 297 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 33.983.297 | 257.804 |
| Gesamt | | | | | 1.961.745 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-----------|---------|-----------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 922.000 | USD | 616.958 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (19.166) |
| AUD | 430.000 | USD | 288.648 | JP Morgan | 21/6/2023 | (9.851) |
| BRL | 446.000 | USD | 89.273 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (1.650) |
| BRL | 6.101.000 | USD | 1.159.700 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 38.937 |
| BRL | 2.941.000 | USD | 576.360 | JP Morgan Standard | 21/6/2023 | 1.445 |
| BRL | 207.000 | USD | 41.618 | Chartered Bank | 21/6/2023 | (950) |
| BRL | 449.000 | USD | 89.435 | BNP Paribas | 19/7/2023 | (1.679) |
| BRL | 208.000 | USD | 41.553 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (900) |
| BRL | 909.000 | USD | 177.216 | HSBC | 19/7/2023 | 446 |
| BRL | 666.000 | USD | 130.623 | JP Morgan | 19/7/2023 | (455) |
| BRL | 2.818.000 | USD | 551.016 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | (246) |
| BRL | 4.182.000 | USD | 821.127 | Barclays Bank | 16/8/2023 | (8.103) |
| BRL | 209.000 | USD | 41.521 | Citibank | 16/8/2023 | (889) |
| CAD | 103.000 | USD | 75.221 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 439 |
| CAD | 833.000 | USD | 613.796 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (1.913) |
| CAD | 309.000 | USD | 224.971 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 2.007 |
| CAD | 698.000 | USD | 524.493 | JP Morgan | 21/6/2023 | (11.774) |
| CAD | 6.288.000 | USD | 4.618.680 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 196 |
| CAD | 3.398.000 | USD | 2.528.992 | Barclays Bank | 19/7/2023 | (31.258) |
| CAD | 698.000 | USD | 524.762 | JP Morgan | 19/7/2023 | (11.691) |
| CAD | 282.000 | USD | 207.525 | Morgan Stanley Standard | 19/7/2023 | (238) |
| CAD | 580.000 | USD | 429.171 | Chartered Bank | 19/7/2023 | (2.836) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-------------|---------|-----------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| CAD | 4.281.000 | USD | 3.206.194 | HSBC | 16/8/2023 | (57.426) |
| CHF | 341.000 | EUR | 347.276 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 3.239 |
| CHF | 215.000 | EUR | 219.376 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 1.595 |
| CHF | 653.000 | USD | 736.577 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (19.510) |
| CLP | 156.567.000 | USD | 191.222 | BNP Paribas | 22/6/2023 | 1.475 |
| CLP | 233.676.000 | USD | 286.987 | Morgan Stanley | 22/6/2023 | 614 |
| CLP | 67.409.000 | USD | 83.106 | HSBC | 19/7/2023 | (444) |
| CNH | 1.388.000 | USD | 201.493 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (6.476) |
| CNH | 1.086.000 | USD | 158.279 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (5.694) |
| CNH | 9.114.000 | USD | 1.319.098 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (38.567) |
| CNH | 29.155.000 | USD | 4.212.698 | JP Morgan | 21/6/2023 | (116.375) |
| CNH | 1.385.000 | USD | 201.513 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | (6.463) |
| CNH | 1.083.000 | USD | 158.204 | Barclays Bank | 19/7/2023 | (5.685) |
| CNH | 8.689.000 | USD | 1.260.443 | BNP Paribas | 19/7/2023 | (36.766) |
| CNH | 8.776.000 | USD | 1.273.481 | JP Morgan | 19/7/2023 | (37.551) |
| CNH | 403.000 | USD | 58.432 | Societe Generale | 19/7/2023 | (1.678) |
| CNH | 2.913.000 | USD | 420.973 | UBS | 19/7/2023 | (10.733) |
| CNH | 1.436.000 | USD | 203.708 | BNP Paribas | 16/8/2023 | (995) |
| CNH | 3.003.000 | USD | 428.861 | JP Morgan | 16/8/2023 | (4.942) |
| CNH | 2.906.000 | USD | 420.907 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | (10.682) |
| EUR | 309.448 | CHF | 307.000 | HSBC | 21/6/2023 | (6.340) |
| EUR | 708.008 | CHF | 698.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (9.665) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 89.224 | NOK | 1.012.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 4.585 |
| EUR | 226.000 | USD | 249.341 | Australia and New Zealand Banking | 21/6/2023 | (7.761) |
| EUR | 3.538.000 | USD | 3.799.413 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (17.508) |
| EUR | 564.000 | USD | 619.937 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (17.055) |
| EUR | 149.000 | USD | 164.495 | Citibank | 21/6/2023 | (5.223) |
| EUR | 1.291.000 | USD | 1.381.028 | JP Morgan | 21/6/2023 | (1.029) |
| EUR | 255.000 | USD | 279.553 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (6.974) |
| EUR | 225.000 | USD | 248.627 | Barclays Bank | 19/7/2023 | (7.723) |
| EUR | 563.000 | USD | 619.731 | BNP Paribas | 19/7/2023 | (16.935) |
| EUR | 149.000 | USD | 164.742 | Citibank | 19/7/2023 | (5.210) |
| EUR | 4.104.627 | USD | 4.505.451 | HSBC | 19/7/2023 | (110.682) |
| EUR | 750.000 | USD | 832.257 | JP Morgan | 19/7/2023 | (29.242) |
| EUR | 270.000 | USD | 296.577 | Bank of America Merrill Lynch | 16/8/2023 | (7.040) |
| EUR | 4.355.226 | USD | 4.808.431 | UBS | 16/8/2023 | (138.053) |
| GBP | 934.000 | USD | 1.160.357 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (3.682) |
| GBP | 213.000 | USD | 265.805 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (2.024) |
| GBP | 101.000 | USD | 125.809 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (729) |
| GBP | 275.000 | USD | 341.259 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (696) |
| GBP | 2.939.000 | USD | 3.584.349 | JP Morgan | 21/6/2023 | 55.338 |
| GBP | 1.547.000 | USD | 1.925.698 | Barclays Bank | 19/7/2023 | (8.796) |
| GBP | 101.000 | USD | 125.865 | BNP Paribas | 19/7/2023 | (715) |
| GBP | 274.000 | USD | 340.202 | Deutsche Bank | 19/7/2023 | (687) |
| GBP | 652.000 | USD | 814.639 | JP Morgan | 19/7/2023 | (6.739) |
| GBP | 301.000 | USD | 377.656 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | (4.684) |
| GBP | 274.000 | USD | 340.354 | Deutsche Bank | 16/8/2023 | (692) |
| GBP | 301.000 | USD | 377.799 | HSBC | 16/8/2023 | (4.667) |
| GBP | 347.000 | USD | 431.751 | JP Morgan | 16/8/2023 | (1.596) |
| GBP | 1.971.000 | USD | 2.490.066 | Standard Chartered Bank | 16/8/2023 | (46.732) |
| HUF | 42.496.000 | USD | 123.230 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (1.613) |
| HUF | 104.000.000 | USD | 299.997 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (2.366) |
| HUF | 234.834.000 | USD | 683.260 | JP Morgan | 21/6/2023 | (11.203) |
| HUF | 191.987.000 | USD | 532.842 | UBS | 21/6/2023 | 16.594 |
| HUF | 451.948.000 | USD | 1.273.318 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | 10.378 |
| HUF | 42.835.000 | USD | 123.234 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (1.567) |
| HUF | 296.654.000 | USD | 852.018 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | (15.273) |
| INR | 34.406.000 | USD | 415.519 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 322 |
| INR | 6.468.000 | USD | 77.744 | Citibank | 21/6/2023 | 430 |
| INR | 597.358.000 | USD | 7.249.402 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (29.571) |
| INR | 10.885.000 | USD | 132.373 | JP Morgan | 21/6/2023 | (814) |
| INR | 599.988.000 | USD | 7.275.404 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (32.420) |
| INR | 518.290.000 | USD | 6.282.798 | HSBC | 17/8/2023 | (34.459) |
| JPY | 17.597.000 | USD | 131.747 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (5.835) |
| JPY | 118.074.000 | USD | 887.840 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (42.989) |
| JPY | 45.122.000 | USD | 335.273 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (12.413) |
| JPY | 38.910.000 | USD | 298.334 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (19.922) |
| JPY | 23.098.000 | USD | 173.598 | JP Morgan | 21/6/2023 | (8.326) |
| JPY | 32.577.000 | USD | 248.790 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (15.692) |
| JPY | 21.087.000 | USD | 161.124 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (10.241) |
| JPY | 117.526.000 | USD | 887.513 | Barclays Bank | 19/7/2023 | (42.894) |
| JPY | 10.338.000 | USD | 77.300 | Citibank | 19/7/2023 | (3.004) |
| JPY | 161.502.000 | USD | 1.185.209 | JP Morgan | 19/7/2023 | (24.548) |
| JPY | 52.350.000 | USD | 393.680 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | (17.458) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------------|-------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| JPY | 32.135.000 | USD | 234.978 | Barclays Bank | 16/8/2023 | (3.018) |
| JPY | 15.774.000 | USD | 114.441 | JP Morgan | 16/8/2023 | (580) |
| JPY | 191.176.000 | USD | 1.416.168 | Societe Generale | 16/8/2023 | (36.202) |
| JPY | 20.350.000 | USD | 153.108 | Standard Chartered Bank | 16/8/2023 | (6.215) |
| KRW | 305.592.000 | USD | 229.934 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 940 |
| KRW | 233.931.000 | USD | 182.212 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (5.478) |
| KRW | 316.996.000 | USD | 241.221 | HSBC | 21/6/2023 | (1.731) |
| KRW | 94.444.000 | USD | 71.878 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (525) |
| KRW | 74.941.000 | USD | 56.279 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 339 |
| KRW | 621.345.000 | USD | 471.029 | HSBC | 19/7/2023 | (867) |
| KRW | 74.786.000 | USD | 56.266 | UBS | 19/7/2023 | 323 |
| KRW | 315.774.000 | USD | 241.141 | HSBC | 16/8/2023 | (1.769) |
| KRW | 74.675.000 | USD | 56.281 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | 326 |
| MXN | 21.889.000 | USD | 1.188.182 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 45.300 |
| MXN | 14.547.000 | USD | 776.751 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 42.997 |
| MXN | 4.733.000 | USD | 263.367 | JP Morgan | 21/6/2023 | 3.345 |
| MXN | 13.465.000 | USD | 733.465 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 25.311 |
| MXN | 1.717.000 | USD | 95.391 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 1.365 |
| MXN | 1.370.000 | USD | 76.810 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (42) |
| MXN | 29.837.000 | USD | 1.617.742 | HSBC | 19/7/2023 | 54.195 |
| MXN | 4.758.000 | USD | 263.293 | JP Morgan | 19/7/2023 | 3.325 |
| MXN | 1.727.000 | USD | 95.393 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | 1.381 |
| MXN | 4.264.000 | USD | 235.842 | Barclays Bank | 16/8/2023 | 1.816 |
| MXN | 1.378.000 | USD | 76.846 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | (42) |
| MXN | 22.838.000 | USD | 1.259.647 | HSBC | 16/8/2023 | 13.253 |
| MXN | 1.736.000 | USD | 95.375 | Standard Chartered Bank | 16/8/2023 | 1.383 |
| NOK | 4.895.000 | USD | 473.403 | Citibank | 21/6/2023 | (34.256) |
| NOK | 2.079.000 | USD | 191.228 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (4.713) |
| NOK | 3.243.000 | USD | 302.216 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (11.276) |
| NOK | 4.378.000 | USD | 423.610 | Citibank | 19/7/2023 | (30.324) |
| NOK | 5.314.000 | USD | 493.215 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (15.846) |
| NOK | 2.073.000 | USD | 191.057 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | (4.599) |
| NZD | 1.064.000 | USD | 667.699 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (29.679) |
| NZD | 165.000 | USD | 103.549 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (4.608) |
| NZD | 871.000 | USD | 540.841 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (18.552) |
| NZD | 6.288.000 | USD | 3.892.714 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (122.158) |
| NZD | 3.299.000 | USD | 2.030.542 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (52.319) |
| NZD | 286.000 | USD | 179.775 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (8.277) |
| NZD | 5.798.000 | USD | 3.587.246 | Australia and New Zealand Banking | 19/7/2023 | (110.855) |
| NZD | 1.064.000 | USD | 667.618 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | (29.660) |
| NZD | 165.000 | USD | 103.520 | Barclays Bank | 19/7/2023 | (4.588) |
| NZD | 766.000 | USD | 465.645 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (6.364) |
| NZD | 3.212.000 | USD | 1.977.100 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | (51.235) |
| NZD | 633.000 | USD | 395.856 | Bank of America Merrill Lynch | 16/8/2023 | (16.361) |
| NZD | 165.000 | USD | 103.478 | Barclays Bank | 16/8/2023 | (4.558) |
| NZD | 766.000 | USD | 465.584 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | (6.353) |
| NZD | 8.316.000 | USD | 5.209.759 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | (224.165) |
| PLN | 250.000 | USD | 56.505 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 2.279 |
| PLN | 912.000 | USD | 218.645 | Citibank | 21/6/2023 | (4.201) |
| PLN | 380.000 | USD | 91.303 | JP Morgan | 21/6/2023 | (1.952) |
| PLN | 4.810.000 | USD | 1.120.211 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 10.792 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| | | | | | | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) | |
|--------------------------------------|-------------|---------|-----------|-----------------------------------|------------|---|--|
| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | USD | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | | |
| PLN | 2.690.000 | USD | 624.329 | UBS | 21/6/2023 | 8.187 | |
| PLN | 3.448.000 | USD | 801.531 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | 7.993 | |
| PLN | 190.000 | USD | 45.582 | JP Morgan | 19/7/2023 | (973) | |
| PLN | 2.110.000 | USD | 500.693 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | (5.306) | |
| PLN | 1.161.000 | USD | 273.809 | UBS | 19/7/2023 | (1.229) | |
| PLN | 2.241.000 | USD | 537.043 | Barclays Bank | 16/8/2023 | (11.638) | |
| PLN | 914.000 | USD | 218.455 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | (4.167) | |
| PLN | 1.199.000 | USD | 282.207 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | (1.101) | |
| SEK | 17.179.000 | USD | 1.663.189 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (81.092) | |
| SEK | 1.895.000 | USD | 183.136 | HSBC | 21/6/2023 | (8.617) | |
| SEK | 1.237.000 | USD | 114.928 | JP Morgan | 21/6/2023 | (1.007) | |
| SEK | 5.252.000 | USD | 502.764 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (19.083) | |
| SEK | 2.134.000 | USD | 198.571 | BNP Paribas | 19/7/2023 | (1.749) | |
| SEK | 2.500.000 | USD | 237.366 | Citibank | 19/7/2023 | (6.788) | |
| SEK | 509.000 | USD | 50.197 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | (3.251) | |
| SEK | 3.307.000 | USD | 323.652 | Societe Generale | 19/7/2023 | (18.643) | |
| SEK | 2.131.000 | USD | 198.577 | BNP Paribas | 16/8/2023 | (1.748) | |
| SEK | 2.500.000 | USD | 237.683 | Citibank | 16/8/2023 | (6.771) | |
| SGD | 101.000 | USD | 75.982 | Australia and New Zealand Banking | 21/6/2023 | (1.337) | |
| SGD | 2.058.000 | USD | 1.545.753 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (24.765) | |
| SGD | 2.055.000 | USD | 1.545.229 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (24.884) | |
| THB | 9.748.000 | USD | 285.087 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (4.442) | |
| THB | 12.113.000 | USD | 356.943 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (8.209) | |
| THB | 12.633.000 | USD | 371.092 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (7.388) | |
| THB | 91.038.000 | USD | 2.658.044 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (37.057) | |
| THB | 48.965.000 | USD | 1.442.925 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (33.222) | |
| THB | 7.746.000 | USD | 223.337 | UBS | 21/6/2023 | (330) | |
| THB | 4.123.000 | USD | 122.145 | Deutsche Bank | 19/7/2023 | (3.109) | |
| THB | 14.957.000 | USD | 438.953 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (7.126) | |
| THB | 7.722.000 | USD | 223.283 | HSBC | 19/7/2023 | (339) | |
| THB | 124.171.000 | USD | 3.659.986 | JP Morgan | 19/7/2023 | (75.011) | |
| THB | 7.955.000 | USD | 234.598 | Societe Generale | 19/7/2023 | (4.927) | |
| THB | 8.308.000 | USD | 242.357 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | (2.494) | |
| THB | 140.657.000 | USD | 4.218.444 | BNP Paribas | 16/8/2023 | (146.047) | |
| THB | 4.630.000 | USD | 134.699 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | (648) | |
| THB | 7.699.000 | USD | 223.236 | HSBC | 16/8/2023 | (329) | |
| THB | 8.285.000 | USD | 242.251 | Standard Chartered Bank | 16/8/2023 | (2.379) | |
| TWD | 4.280.000 | USD | 142.593 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (3.255) | |
| TWD | 12.658.000 | USD | 418.045 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (5.954) | |
| TWD | 2.404.000 | USD | 79.550 | JP Morgan | 21/6/2023 | (1.286) | |
| TWD | 37.825.000 | USD | 1.264.416 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (32.993) | |
| TWD | 9.952.000 | USD | 327.999 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (4.004) | |
| TWD | 1.276.000 | USD | 41.727 | Barclays Bank | 19/7/2023 | (76) | |
| TWD | 1.272.000 | USD | 41.723 | HSBC | 16/8/2023 | (75) | |
| USD | 1.655.327 | AUD | 2.506.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 30.525 | |
| USD | 695.339 | AUD | 1.041.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 20.392 | |
| USD | 686.925 | AUD | 1.016.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 28.185 | |
| USD | 72.029 | AUD | 107.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 2.654 | |
| USD | 4.249.993 | AUD | 6.330.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 145.846 | |
| USD | 73.528 | AUD | 110.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 2.208 | |
| USD | 811.248 | AUD | 1.243.000 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | 4.485 | |
| USD | 301.606 | AUD | 461.000 | Barclays Bank | 19/7/2023 | 2.396 | |
| USD | 5.361.586 | AUD | 8.009.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 163.380 | |

| | | | | | | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) | |
|--------------------------------------|-----------|---------|-------------|-------------------------------|------------|---|--|
| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | USD | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | | |
| USD | 72.115 | AUD | 107.000 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | 2.667 | |
| USD | 810.827 | AUD | 1.241.000 | Bank of America Merrill Lynch | 16/8/2023 | 4.537 | |
| USD | 301.929 | AUD | 461.000 | Barclays Bank | 16/8/2023 | 2.413 | |
| USD | 291.714 | AUD | 438.000 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | 7.141 | |
| USD | 5.268.647 | AUD | 7.763.000 | Standard Chartered Bank | 16/8/2023 | 224.948 | |
| USD | 162.250 | BRL | 823.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 559 | |
| USD | 53.900 | BRL | 290.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (3.075) | |
| USD | 101.132 | BRL | 506.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 1.720 | |
| USD | 621.749 | BRL | 3.233.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (13.424) | |
| USD | 232.883 | BRL | 1.254.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | (13.485) | |
| USD | 381.694 | BRL | 1.904.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 7.624 | |
| USD | 100.938 | BRL | 508.000 | BNP Paribas | 19/7/2023 | 1.651 | |
| USD | 119.766 | BRL | 601.000 | Citibank | 19/7/2023 | 2.302 | |
| USD | 162.074 | BRL | 827.000 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | 439 | |
| USD | 261.895 | BRL | 1.313.000 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | 5.273 | |
| USD | 119.723 | BRL | 604.000 | Citibank | 16/8/2023 | 2.299 | |
| USD | 162.017 | BRL | 831.000 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | 462 | |
| USD | 261.848 | BRL | 1.320.000 | Standard Chartered Bank | 16/8/2023 | 5.227 | |
| USD | 1.456.952 | CAD | 1.980.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 2.535 | |
| USD | 1.902.142 | CAD | 2.563.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 19.480 | |
| USD | 544.673 | CAD | 734.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 5.510 | |
| USD | 223.763 | CAD | 304.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 459 | |
| USD | 169.370 | CAD | 230.000 | BNP Paribas | 19/7/2023 | 306 | |
| USD | 755.615 | CAD | 1.017.000 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | 8.059 | |
| USD | 544.279 | CAD | 733.000 | JP Morgan | 19/7/2023 | 5.480 | |
| USD | 223.922 | CAD | 304.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 464 | |
| USD | 168.745 | CAD | 229.000 | BNP Paribas | 16/8/2023 | 311 | |
| USD | 329.900 | CAD | 445.000 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | 2.593 | |
| USD | 543.839 | CAD | 732.000 | JP Morgan | 16/8/2023 | 5.437 | |
| USD | 224.064 | CAD | 304.000 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | 466 | |
| USD | 531.126 | CHF | 489.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (5.850) | |
| USD | 86.154 | CLP | 69.001.000 | Bank of America Merrill Lynch | 22/6/2023 | 1.230 | |
| USD | 185.373 | CLP | 151.075.000 | Barclays Bank | 22/6/2023 | (564) | |
| USD | 389.128 | CLP | 309.985.000 | BNP Paribas | 22/6/2023 | 7.609 | |
| USD | 107.550 | CLP | 88.402.000 | Goldman Sachs | 22/6/2023 | (1.252) | |
| USD | 78.494 | CLP | 65.394.000 | JP Morgan | 22/6/2023 | (1.991) | |
| USD | 1.030.410 | CLP | 830.586.000 | Morgan Stanley | 22/6/2023 | 8.153 | |
| USD | 211.480 | CLP | 171.227.000 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | 1.508 | |
| USD | 158.546 | CLP | 129.016.000 | Barclays Bank | 19/7/2023 | 336 | |
| USD | 1.108.935 | CLP | 894.251.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 12.331 | |
| USD | 211.517 | CLP | 171.889.000 | Barclays Bank | 16/8/2023 | 1.425 | |
| USD | 342.199 | CLP | 273.841.000 | Citibank | 16/8/2023 | 7.497 | |
| USD | 841.767 | CLP | 679.714.000 | HSBC | 16/8/2023 | 10.987 | |
| USD | 102.177 | CNH | 701.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 3.685 | |
| USD | 2.788.630 | CNH | 18.986.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 121.068 | |
| USD | 2.438.305 | CNH | 16.792.000 | HSBC | 21/6/2023 | 79.003 | |
| USD | 314.357 | CNH | 2.151.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 12.138 | |
| USD | 3.098.410 | CNH | 21.186.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 114.772 | |
| USD | 737.390 | CNH | 5.070.000 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | 21.683 | |
| USD | 550.965 | EUR | 508.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 7.944 | |
| USD | 1.323.358 | EUR | 1.205.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 35.286 | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| | | | | | | | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | | | | | | | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) |
|--------------------------------------|-----------|---------|---------------|-------------------------------|------------|---------|---|-----------|---------|------------|-------------------------------|------------|----------|--|---|
| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | USD | Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | USD | | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | | | | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | | | | | | | | | | |
| USD | 675.498 | EUR | 629.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 3.136 | USD | 578.808 | MXN | 10.561.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (16.322) | | |
| USD | 22.851 | EUR | 21.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 403 | USD | 117.614 | MXN | 2.158.000 | Citibank | 21/6/2023 | (3.993) | | |
| USD | 786.948 | EUR | 727.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 9.830 | USD | 287.360 | MXN | 5.207.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (6.064) | | |
| USD | 78.785 | EUR | 74.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (317) | USD | 491.037 | MXN | 9.029.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | (17.763) | | |
| USD | 1.323.126 | EUR | 1.203.000 | Barclays Bank | 19/7/2023 | 35.089 | USD | 432.382 | MXN | 7.949.000 | JP Morgan | 19/7/2023 | (13.047) | | |
| USD | 787.095 | EUR | 726.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 9.776 | USD | 307.261 | NOK | 3.283.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 12.731 | | |
| USD | 427.572 | EUR | 397.000 | Barclays Bank | 16/8/2023 | 1.844 | USD | 147.088 | NOK | 1.536.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 9.288 | | |
| USD | 787.151 | EUR | 725.000 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | 9.689 | USD | 232.531 | NOK | 2.464.000 | Citibank | 21/6/2023 | 11.476 | | |
| USD | 851.033 | GBP | 687.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 246 | USD | 190.332 | NOK | 1.976.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 13.058 | | |
| USD | 241.221 | GBP | 199.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (5.223) | USD | 4.657.680 | NOK | 48.434.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 312.498 | | |
| USD | 874.641 | GBP | 701.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 6.516 | USD | 298.450 | NOK | 3.210.000 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | 10.088 | | |
| USD | 520.521 | HKD | 4.071.000 | HSBC | 21/6/2023 | 605 | USD | 232.442 | NOK | 2.460.000 | Citibank | 19/7/2023 | 11.455 | | |
| USD | 766.312 | HUF | 271.141.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (9.650) | USD | 4.714.032 | NOK | 49.555.000 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | 262.392 | | |
| USD | 166.216 | HUF | 57.212.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 2.484 | USD | 189.321 | NOK | 1.996.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 10.016 | | |
| USD | 136.766 | HUF | 46.794.000 | UBS | 21/6/2023 | 2.849 | USD | 212.402 | NOK | 2.265.000 | Bank of America Merrill Lynch | 16/8/2023 | 8.675 | | |
| USD | 253.797 | HUF | 89.989.000 | Barclays Bank | 19/7/2023 | (1.805) | USD | 86.130 | NOK | 942.000 | Citibank | 16/8/2023 | 1.401 | | |
| USD | 99.410 | HUF | 35.000.000 | BNP Paribas | 19/7/2023 | (3) | USD | 4.376.052 | NOK | 45.845.000 | JP Morgan | 16/8/2023 | 252.488 | | |
| USD | 166.171 | HUF | 57.636.000 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | 2.464 | USD | 374.446 | NZD | 600.000 | Citibank | 21/6/2023 | 14.660 | | |
| USD | 312.754 | HUF | 108.635.000 | UBS | 19/7/2023 | 4.191 | USD | 359.249 | NZD | 576.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 13.855 | | |
| USD | 98.754 | HUF | 35.000.000 | Barclays Bank | 16/8/2023 | 32 | USD | 454.881 | NZD | 734.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 14.743 | | |
| USD | 174.828 | HUF | 61.500.000 | UBS | 16/8/2023 | 1.361 | USD | 103.223 | NZD | 167.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 3.083 | | |
| USD | 189.131 | INR | 15.496.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 1.842 | USD | 374.375 | NZD | 600.000 | Chartered Bank | 21/6/2023 | 3.083 | | |
| USD | 388.183 | INR | 32.165.862 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (582) | USD | 224.748 | NZD | 361.000 | Citibank | 19/7/2023 | 14.624 | | |
| USD | 389.766 | INR | 31.998.000 | HSBC | 21/6/2023 | 3.028 | USD | 60.116 | NZD | 98.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 8.297 | | |
| USD | 436.259 | INR | 35.872.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 2.701 | USD | 447.931 | NZD | 1.919.000 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | 1.357 | | |
| USD | 678.970 | INR | 56.068.138 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 1.315 | USD | 346.923 | PLN | 1.548.000 | Chartered Bank | 19/7/2023 | 1.357 | | |
| USD | 478.217 | INR | 39.311.000 | BNP Paribas | 19/7/2023 | 3.660 | USD | 735.569 | PLN | 3.074.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (3.295) | | |
| USD | 677.006 | INR | 56.010.000 | HSBC | 19/7/2023 | 859 | USD | 282.547 | PLN | 1.178.000 | HSBC | 21/6/2023 | (17.068) | | |
| USD | 198.048 | INR | 16.256.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 1.807 | USD | 131.201 | PLN | 549.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 12.762 | | |
| USD | 135.709 | INR | 11.185.000 | UBS | 19/7/2023 | 685 | USD | 636.054 | PLN | 2.677.000 | BNP Paribas | 19/7/2023 | 5.976 | | |
| USD | 338.426 | INR | 28.144.000 | HSBC | 17/8/2023 | (869) | USD | 282.607 | PLN | 1.180.000 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | 2.306 | | |
| USD | 135.699 | INR | 11.201.000 | Morgan Stanley | 17/8/2023 | 663 | USD | 140.241 | PLN | 592.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 7.547 | | |
| USD | 85.664 | JPY | 11.024.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 6.784 | USD | 1.483.118 | SEK | 15.404.000 | BNP Paribas | 16/8/2023 | 5.955 | | |
| USD | 221.061 | JPY | 29.529.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 9.773 | USD | 42.548 | SEK | 462.000 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | 1.446 | | |
| USD | 133.857 | JPY | 18.658.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 354 | USD | 371.560 | SEK | 3.801.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 64.488 | | |
| USD | 624.736 | JPY | 82.632.000 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | 30.888 | USD | 458.897 | SEK | 4.731.000 | Citibank | 21/6/2023 | — | | |
| USD | 133.825 | JPY | 18.570.000 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | 369 | USD | 481.416 | SEK | 4.920.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 21.507 | | |
| USD | 133.807 | JPY | 18.485.000 | Chartered Bank | 16/8/2023 | 377 | USD | 481.416 | SEK | 4.920.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 23.196 | | |
| USD | 666.325 | KRW | 874.308.672 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 5.788 | USD | 461.000 | SEK | 461.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 28.309 | | |
| USD | 3.526.932 | KRW | 4.574.565.612 | JP Morgan | 21/6/2023 | 70.857 | USD | 458.746 | SEK | 4.723.000 | Citibank | 19/7/2023 | 2 | | |
| USD | 952.549 | KRW | 1.255.629.865 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 3.924 | USD | 695.425 | SEK | 7.225.000 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | 23.137 | | |
| USD | 65.971 | KRW | 87.564.851 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (184) | USD | 42.489 | SEK | 460.000 | HSBC | 19/7/2023 | 29.053 | | |
| USD | 306.908 | KRW | 409.759.000 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | (3.152) | USD | 796.435 | SEK | 8.055.000 | Citibank | 16/8/2023 | 2 | | |
| USD | 369.151 | KRW | 487.130.000 | BNP Paribas | 19/7/2023 | 546 | USD | 341.088 | SGD | 452.000 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | 52.437 | | |
| USD | 51.511 | KRW | 66.617.000 | Societe Generale | 19/7/2023 | 1.103 | USD | 497.772 | SGD | 667.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 7.032 | | |
| USD | 3.951.242 | KRW | 5.217.381.000 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | 3.322 | USD | 2.691.837 | SGD | 3.566.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 4.819 | | |
| USD | 220.616 | KRW | 290.279.000 | UBS | 19/7/2023 | 966 | USD | 164.910 | SGD | 219.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 56.344 | | |
| USD | 4.456.764 | KRW | 5.866.697.000 | BNP Paribas | 16/8/2023 | 9.532 | USD | 359.352 | SGD | 482.000 | HSBC | 21/6/2023 | 3.056 | | |
| USD | 44.755 | KRW | 59.156.000 | Standard Chartered Bank | 16/8/2023 | (88) | USD | 3.692.553 | SGD | 4.950.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 3.124 | | |
| USD | 220.584 | KRW | 289.739.000 | UBS | 16/8/2023 | 948 | USD | 558.677 | SGD | 755.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 34.201 | | |
| | | | | | | | USD | 259.468 | SGD | 350.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 686 | | |
| | | | | | | | USD | 259.468 | SGD | 350.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 225 | | |
| | | | | | | | USD | 259.468 | SGD | 350.000 | BNP Paribas | 19/7/2023 | 58.269 | | |
| | | | | | | | USD | 259.468 | SGD | 350.000 | Citibank | 19/7/2023 | 80.920 | | |
| | | | | | | | USD | 259.468 | SGD | 350.000 | JP Morgan | 19/7/2023 | 4.495 | | |
| | | | | | | | USD | 259.468 | SGD | 350.000 | Barclays Bank | 16/8/2023 | 241 | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Style Factor Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 233.977 | SGD | 314.000 | BNP Paribas | 16/8/2023 | 1.414 |
| USD | 5.928.369 | SGD | 7.830.000 | Citibank | 16/8/2023 | 129.087 |
| USD | 237.175 | SGD | 318.000 | JP Morgan | 16/8/2023 | 1.649 |
| USD | 455.144 | THB | 15.824.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (429) |
| USD | 118.494 | THB | 4.007.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 3.133 |
| USD | 156.536 | THB | 5.316.000 | UBS | 21/6/2023 | 3.488 |
| USD | 106.303 | THB | 3.587.000 | HSBC | 19/7/2023 | 2.742 |
| USD | 168.678 | THB | 5.709.000 | UBS | 19/7/2023 | 3.852 |
| USD | 106.243 | THB | 3.576.000 | UBS | 16/8/2023 | 2.709 |
| USD | 1.830.160 | TWD | 55.901.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 10.259 |
| USD | 7.470.800 | TWD | 225.917.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 115.893 |
| USD | 527.303 | TWD | 16.115.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 2.666 |
| USD | 6.448.617 | TWD | 194.716.000 | Bank of America Merrill Lynch | 19/7/2023 | 92.758 |
| USD | 81.236 | TWD | 2.446.000 | Citibank | 19/7/2023 | 1.395 |
| USD | 845.451 | TWD | 25.735.000 | HSBC | 19/7/2023 | 5.419 |
| USD | 294.747 | TWD | 8.965.000 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | 2.114 |
| USD | 65.493 | TWD | 1.990.000 | HSBC | 16/8/2023 | 336 |
| USD | 294.834 | TWD | 8.938.000 | Standard Chartered Bank | 16/8/2023 | 2.184 |
| USD | 7.288.266 | TWD | 221.425.000 | UBS | 16/8/2023 | 38.330 |
| USD | 190.905 | ZAR | 3.423.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 17.319 |
| USD | 466.711 | ZAR | 9.025.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 9.038 |
| USD | 1.027.048 | ZAR | 18.961.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 65.503 |
| USD | 326.524 | ZAR | 6.275.000 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | 9.199 |
| USD | 1.276.477 | ZAR | 23.837.000 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | 71.048 |
| USD | 268.371 | ZAR | 5.226.000 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | 4.844 |
| USD | 616.883 | ZAR | 11.646.000 | Morgan Stanley | 16/8/2023 | 29.619 |
| ZAR | 2.300.000 | USD | 125.404 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (8.767) |
| ZAR | 4.818.000 | USD | 249.511 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (5.182) |
| ZAR | 5.095.000 | USD | 277.648 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (19.272) |
| ZAR | 7.633.000 | USD | 420.828 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (33.745) |
| ZAR | 2.305.000 | USD | 125.339 | Deutsche Bank | 19/7/2023 | (8.776) |
| ZAR | 4.830.000 | USD | 249.360 | Goldman Sachs | 19/7/2023 | (5.108) |
| ZAR | 3.373.000 | USD | 183.368 | Morgan Stanley | 19/7/2023 | (12.796) |
| ZAR | 7.651.000 | USD | 420.750 | Standard Chartered Bank | 19/7/2023 | (33.842) |
| ZAR | 4.845.000 | USD | 249.343 | Goldman Sachs | 16/8/2023 | (5.027) |
| | | | | | | 931.002 |
| Auf AUD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| AUD | 50.513.376 | USD | 34.124.270 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.380.807) |
| USD | 700.349 | AUD | 1.048.148 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 20.924 |
| | | | | | | (1.359.883) |
| Auf BRL lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| BRL | 19.240 | USD | 3.806 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2023 | (15) |
| BRL | 19.342 | USD | 3.814 | State Street Bank & Trust Company | 5/7/2023 | (23) |
| USD | 3.814 | BRL | 19.240 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2023 | 23 |
| | | | | | | (15) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--|----------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 439.094 | USD | 495.746 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (13.914) |
| USD | 11.807 | CHF | 10.561 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 217 |
| | | | | | | (13.697) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 4.278.617 | USD | 4.717.766 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (145.831) |
| USD | 284.219 | EUR | 259.851 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 6.552 |
| | | | | | | (139.279) |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 478.842 | USD | 606.198 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (13.272) |
| USD | 62.597 | GBP | 50.291 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 320 |
| | | | | | | (12.952) |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| JPY | 11.705.901.589 | USD | 87.017.269 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (3.337.116) |
| USD | 4.480.599 | JPY | 606.442.125 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 145.421 |
| | | | | | | (3.191.695) |
| Auf NZD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| NZD | 237 | USD | 149 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (8) |
| USD | 3 | NZD | 6 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| | | | | | | (8) |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SEK | 37.246 | USD | 3.484 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (55) |
| USD | 182 | SEK | 1.946 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 3 |
| | | | | | | (52) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 437.026.445) | | | | | | (3.786.579) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 87,07 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 87,07 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 12,93 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|----------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Belgien Fortsetzung | | | |
| ANLEIHEN | | | | | | | |
| Österreich | | | | | | | |
| EUR 500.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 465.190 | 0,07 | EUR 650.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2028 | 595.491 | 0,09 |
| EUR 700.000 | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 4,125% 18/1/2027^ | 697.200 | 0,10 | EUR 430.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,00% 22/6/2031 | 374.633 | 0,06 |
| EUR 500.000 | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 2,00% 25/8/2032 | 449.035 | 0,07 | EUR 630.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2031 (Zero Coupon) | 498.103 | 0,08 |
| EUR 2.635.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,65% 21/10/2024 | 2.591.206 | 0,39 | EUR 2.445.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,25% 22/4/2033 | 2.111.527 | 0,32 |
| EUR 1.055.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,75% 20/10/2026 | 990.888 | 0,15 | EUR 1.398.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,00% 22/6/2033 | 1.402.655 | 0,21 |
| EUR 1.660.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,50% 20/4/2027 | 1.528.694 | 0,23 | EUR 2.597.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 2,75% 22/4/2039 | 2.427.234 | 0,37 |
| EUR 2.556.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,90% 23/5/2029 | 2.583.656 | 0,39 | EUR 1.706.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,45% 22/6/2043 | 1.720.348 | 0,26 |
| EUR 2.178.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,90% 20/2/2032 | 1.849.950 | 0,28 | EUR 200.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,75% 22/6/2045 | 211.794 | 0,03 |
| EUR 110.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,40% 23/5/2034 | 104.346 | 0,02 | EUR 223.600 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,70% 22/6/2050 | 157.193 | 0,02 |
| EUR 400.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 0,25% 20/10/2036 | 277.680 | 0,04 | EUR 244.400 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,40% 22/6/2053 | 153.153 | 0,02 |
| EUR 1.900.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 4,15% 15/3/2037 | 2.114.529 | 0,32 | EUR 2.738.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,30% 22/6/2054 | 2.642.334 | 0,40 |
| EUR 1.543.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,85% 23/5/2049 | 1.194.529 | 0,18 | EUR 95.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 2,15% 22/6/2066^ | 69.721 | 0,01 |
| EUR 568.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 3,80% 26/1/2062 | 657.715 | 0,10 | EUR 740.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS (traded in Belgium) 0,35% 22/6/2032 | 592.000 | 0,09 |
| | | 15.504.618 | 2,34 | | | 25.654.341 | 3,87 |
| Belgien | | | | Kanada | | | |
| EUR 300.000 | BNP Paribas Fortis SA RegS 24/10/2023 (Zero Coupon) | 295.797 | 0,05 | EUR 1.920.000 | Bank of Montreal RegS 3,375% 4/7/2026^ | 1.912.882 | 0,29 |
| EUR 600.000 | ING Belgium SA RegS 0,75% 28/9/2026^ | 553.098 | 0,08 | EUR 1.190.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 14/9/2029 | 968.505 | 0,15 |
| EUR 200.000 | KBC Group NV RegS 0,75% 24/1/2030 | 160.720 | 0,03 | EUR 2.416.000 | CPPIB Capital Inc RegS 0,875% 6/2/2029 | 2.127.819 | 0,32 |
| EUR 1.000.000 | KBC Group NV RegS FRN 5/4/2033 | 984.700 | 0,15 | EUR 1.475.000 | National Bank of Canada RegS 3,50% 25/4/2028 | 1.484.874 | 0,22 |
| EUR 4.264.029 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,50% 22/10/2024^ | 4.125.363 | 0,62 | EUR 1.600.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 26/4/2027 | 1.413.530 | 0,21 |
| EUR 4.925.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2025 | 4.732.383 | 0,71 | | | 7.907.610 | 1,19 |
| EUR 585.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 4,50% 28/3/2026 | 613.139 | 0,09 | Zypern | | | |
| EUR 625.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2027 (Zero Coupon)^ | 557.794 | 0,08 | EUR 84.000 | Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023 | 84.182 | 0,01 |
| | | | | EUR 480.000 | Cyprus Government International Bond RegS 1,50% 16/4/2027 | 447.958 | 0,07 |
| | | | | | | 532.140 | 0,08 |
| | | | | Dänemark | | | |
| | | | | EUR 1.350.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 10/1/2031 | 1.355.332 | 0,20 |
| | | | | DKK 0 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Dänemark Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | |
| EUR 500.000 | Orsted A/S RegS FRN 8/12/3022 | 498.215 | 0,08 | EUR 1.500.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 23/1/2027 | 1.418.190 | 0,21 |
| GBP 300.000 | Orsted AS RegS 4,875% 12/1/2032 | 329.971 | 0,05 | EUR 1.500.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 30/5/2028 | 1.300.080 | 0,20 |
| | | 2.183.518 | 0,33 | EUR 1.800.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 11/7/2030 | 1.464.732 | 0,22 |
| | Finnland | | | EUR 600.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 13/4/2031 | 595.686 | 0,09 |
| EUR 2.500.000 | Finland Government Bond RegS 15/9/2024 (Zero Coupon)* | 2.408.725 | 0,36 | EUR 1.200.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 1.078.500 | 0,16 |
| EUR 400.000 | Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2027 | 381.680 | 0,06 | EUR 700.000 | BPCE SA RegS 0,625% 26/9/2023 | 693.560 | 0,10 |
| EUR 1.342.000 | Finland Government Bond RegS 3,00% 15/9/2033 | 1.355.098 | 0,20 | EUR 200.000 | BPCE SA RegS 2,25% 12/3/2025 | 192.246 | 0,03 |
| EUR 1.330.000 | Finland Government Bond RegS 1,125% 15/4/2034 | 1.106.440 | 0,17 | EUR 1.100.000 | BPCE SA RegS FRN 15/9/2027 | 970.783 | 0,15 |
| EUR 100.000 | Finland Government Bond RegS 2,75% 15/4/2038 | 95.404 | 0,01 | EUR 1.500.000 | BPCE SA RegS 4,00% 29/11/2032 | 1.499.355 | 0,23 |
| EUR 410.000 | Finland Government Bond RegS 0,25% 15/9/2040 | 254.827 | 0,04 | EUR 1.200.000 | BPCE SA RegS FRN 2/2/2034 | 982.440 | 0,15 |
| EUR 270.000 | Finland Government Bond RegS 0,50% 15/4/2043 | 166.277 | 0,03 | EUR 3.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 21/1/2027 | 2.667.480 | 0,40 |
| EUR 75.000 | Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047 | 54.558 | 0,01 | EUR 100.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 10/11/2027 | 86.890 | 0,01 |
| EUR 350.000 | Finland Government Bond RegS 0,125% 15/4/2052 | 161.308 | 0,02 | EUR 1.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 23/3/2028 | 859.040 | 0,13 |
| EUR 800.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,125% 17/7/2024 | 769.096 | 0,12 | EUR 4.900.000 | BPCE SFH SA RegS 3,25% 12/4/2028 | 4.903.087 | 0,74 |
| EUR 700.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 | 606.697 | 0,09 | EUR 2.000.000 | BPCE SFH SA RegS 0,01% 16/10/2028 | 1.689.900 | 0,25 |
| EUR 427.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 16/6/2028 | 353.966 | 0,05 | EUR 2.300.000 | BPCE SFH SA RegS 3,00% 17/10/2029^ | 2.276.862 | 0,34 |
| EUR 1.020.000 | OP Corporate Bank Plc RegS FRN 9/6/2030 | 944.683 | 0,14 | EUR 1.100.000 | BPCE SFH SA RegS 3,125% 20/1/2033 | 1.088.868 | 0,16 |
| EUR 1.153.000 | OP Mortgage Bank RegS 2,75% 25/1/2030 | 1.128.107 | 0,17 | EUR 400.000 | Bpifrance RegS 0,125% 25/11/2023 | 393.576 | 0,06 |
| | | 9.786.866 | 1,47 | EUR 400.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 3,90% 20/10/2023 | 400.568 | 0,06 |
| | Frankreich | | | EUR 1.500.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA RegS 3,125% 23/2/2033^ | 1.491.375 | 0,22 |
| EUR 100.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 0,375% 30/4/2024 | 97.231 | 0,01 | EUR 300.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA RegS 0,25% 7/2/2035 | 214.251 | 0,03 |
| EUR 300.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,00% 31/1/2028 | 273.924 | 0,04 | EUR 600.000 | Caisse Francaise de Financement Local RegS 0,375% 11/5/2024 | 581.784 | 0,09 |
| EUR 1.000.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 0,125% 29/9/2031 | 782.310 | 0,12 | EUR 100.000 | Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026 | 92.810 | 0,01 |
| EUR 3.400.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 3,375% 25/5/2033 | 3.439.678 | 0,52 | EUR 500.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023 | 496.000 | 0,08 |
| EUR 500.000 | Arkea Home Loans SFH SA RegS 3,00% 30/3/2027 | 495.450 | 0,07 | EUR 600.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024 | 586.278 | 0,09 |
| EUR 400.000 | AXA SA RegS FRN 10/7/2042 | 302.144 | 0,05 | EUR 400.000 | Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 2,125% 29/7/2032 | 347.688 | 0,05 |
| EUR 500.000 | AXA SA RegS FRN 11/7/2043 | 500.970 | 0,08 | EUR 4.900.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 2,875% 23/6/2028 | 4.829.293 | 0,73 |
| EUR 400.000 | AXA SA RegS FRN 28/5/2049 | 362.252 | 0,05 | EUR 1.000.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 3,125% 16/8/2029^ | 997.060 | 0,15 |
| EUR 100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,01% 7/3/2025 | 93.458 | 0,01 | EUR 800.000 | Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 0,05% 6/12/2029 | 654.800 | 0,10 |
| EUR 200.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1,00% 23/5/2025 | 189.516 | 0,03 | EUR 700.000 | Credit Agricole SA RegS 0,75% 5/12/2023 | 689.696 | 0,10 |
| EUR 500.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1,25% 26/5/2027 | 453.650 | 0,07 | EUR 200.000 | Credit Agricole SA RegS 1,375% 13/3/2025 | 191.732 | 0,03 |
| EUR 3.000.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 5,125% 13/1/2033 | 2.991.450 | 0,45 | EUR 2.600.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 22/4/2026 | 2.449.408 | 0,37 |
| EUR 100.000 | BNP Paribas SA RegS 1,00% 17/4/2024 | 97.613 | 0,01 | EUR 400.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 5/6/2030 | 372.540 | 0,06 |
| EUR 200.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025 | 191.904 | 0,03 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|----------------|--|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | |
| EUR 600.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 5/10/2023 | 594.558 | 0,09 | EUR 785.898 | France Government Bond OAT RegS 2,00% 25/5/2048 | 616.639 | 0,09 |
| EUR 300.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 | 255.447 | 0,04 | EUR 568.727 | France Government Bond OAT RegS 4,00% 25/4/2060 | 650.971 | 0,10 |
| EUR 400.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 0,25% 30/4/2024 | 387.860 | 0,06 | EUR 545.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/5/2066 | 365.575 | 0,06 |
| EUR 100.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 2,75% 8/12/2027 | 98.006 | 0,02 | EUR 1.102.369 | France Government Bond OAT RegS (traded in France) 0,50% 25/6/2044 | 648.722 | 0,10 |
| EUR 2.200.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 3,25% 20/4/2029 | 2.202.772 | 0,33 | EUR 12.847.000 | France Government Bond OAT RegS (traded in France) 3,00% 25/5/2054 | 11.943.727 | 1,80 |
| EUR 400.000 | Electricite de France SA RegS 1,00% 29/11/2033 [^] | 289.356 | 0,04 | EUR 2.000.974 | France Government Bond OAT RegS (traded in Germany) 0,50% 25/6/2044 [^] | 1.177.533 | 0,18 |
| EUR 1.400.000 | Electricite de France SA RegS 4,625% 25/1/2043 | 1.333.248 | 0,20 | EUR 355.707 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 A' RegS FRN 27/5/2061 | 357.659 | 0,05 |
| EUR 700.000 | Engie SA RegS 0,375% 26/10/2029 [^] | 575.953 | 0,09 | EUR 200.000 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 B' RegS FRN 27/5/2061 | 195.416 | 0,03 |
| EUR 200.000 | Engie SA RegS 4,00% 11/1/2035 | 201.044 | 0,03 | EUR 1.600.000 | La Banque Postale Home Loan SFH SA RegS 3,125% 19/2/2029 | 1.594.272 | 0,24 |
| EUR 500.000 | Engie SA RegS 1,375% 21/6/2039 | 337.755 | 0,05 | EUR 2.800.000 | La Banque Postale SA RegS 4,375% 17/1/2030 | 2.763.992 | 0,42 |
| EUR 100.000 | Engie SA RegS 1,25% 24/10/2041 | 61.874 | 0,01 | EUR 300.000 | Orange SA RegS 1,00% 12/5/2025 | 286.644 | 0,04 |
| EUR 100.000 | FCT Autonoria '2023- DE C' RegS FRN 26/1/2043 | 99.824 | 0,02 | EUR 200.000 | Orange SA RegS 1,00% 12/9/2025 | 189.906 | 0,03 |
| EUR 132.829 | FCT Noria '2021-1 C' RegS FRN 25/10/2049 | 130.696 | 0,02 | EUR 500.000 | Orange SA RegS 2,375% 18/5/2032 | 458.725 | 0,07 |
| EUR 66.414 | FCT Noria '2021-1 D' RegS FRN 25/10/2049 | 64.469 | 0,01 | EUR 200.000 | Orange SA RegS FRN 31/12/2099 | 190.516 | 0,03 |
| EUR 76.112 | FCT Pixel '2021-1 D' RegS FRN 25/2/2038 | 74.350 | 0,01 | EUR 1.100.000 | RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 1,625% 8/10/2024 | 1.069.200 | 0,16 |
| EUR 3.800.000 | France Government Bond OAT RegS 2,25% 25/5/2024 [^] | 3.768.574 | 0,57 | EUR 300.000 | Societe Generale SA RegS FRN 6/12/2030 | 290.505 | 0,04 |
| EUR 270.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/11/2024 | 265.402 | 0,04 | EUR 300.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 2/6/2025 | 283.026 | 0,04 |
| EUR 9.775.000 | France Government Bond OAT RegS 25/3/2025 (Zero Coupon) | 9.289.671 | 1,40 | EUR 300.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 28/1/2026 | 278.550 | 0,04 |
| EUR 4.490.000 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2025 | 4.291.183 | 0,65 | EUR 1.500.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026 | 1.342.635 | 0,20 |
| EUR 1.835.000 | France Government Bond OAT RegS 1,00% 25/11/2025 [^] | 1.760.095 | 0,27 | EUR 800.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,125% 18/7/2029 | 667.024 | 0,10 |
| EUR 958.948 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2026 (Zero Coupon) | 891.467 | 0,13 | EUR 900.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 11/2/2030 | 731.043 | 0,11 |
| EUR 1.475.000 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2026 | 1.383.904 | 0,21 | EUR 1.800.000 | Societe Generale SFH SA RegS 3,125% 24/2/2032 | 1.790.856 | 0,27 |
| EUR 4.024.785 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2027 (Zero Coupon) | 3.652.975 | 0,55 | EUR 1.400.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 1.222.606 | 0,18 |
| EUR 13.060.000 | France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/2/2028 | 11.982.158 | 1,81 | EUR 1.000.000 | UNEDIC ASSEO RegS 0,875% 25/5/2028 | 907.350 | 0,14 |
| EUR 3.230.000 | France Government Bond OAT RegS 2,75% 25/2/2029 | 3.244.826 | 0,49 | EUR 1.700.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 1.536.086 | 0,23 |
| EUR 1.243.403 | France Government Bond OAT RegS 25/11/2031 (Zero Coupon) [^] | 991.029 | 0,15 | EUR 500.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 412.540 | 0,06 |
| EUR 3.090.000 | France Government Bond OAT RegS 2,00% 25/11/2032 [^] | 2.890.942 | 0,44 | | | 140.955.309 | 21,23 |
| EUR 1.120.000 | France Government Bond OAT RegS 3,00% 25/5/2033 [^] | 1.135.322 | 0,17 | | | | |
| EUR 700.000 | France Government Bond OAT RegS 1,25% 25/5/2038 | 543.123 | 0,08 | | | | |
| EUR 1.215.000 | France Government Bond OAT RegS 4,00% 25/10/2038 | 1.344.653 | 0,20 | | | | |
| EUR 4.399.508 | France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2040 | 2.862.144 | 0,43 | | | | |
| EUR 840.000 | France Government Bond OAT RegS 2,50% 25/5/2043 | 745.912 | 0,11 | | | | |
| EUR 2.410.000 | France Government Bond OAT RegS 3,25% 25/5/2045 | 2.404.891 | 0,36 | | | | |
| | | | | | Deutschland | | |
| | | | | EUR 2.100.000 | Allianz SE RegS FRN 7/9/2038 [^] | 2.062.725 | 0,31 |
| | | | | EUR 4.150.000 | Bayer AG RegS 4,625% 26/5/2033 [^] | 4.243.914 | 0,64 |
| | | | | EUR 1.700.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 1.333.412 | 0,20 |
| | | | | EUR 25.000 | Berlin Hyp AG RegS 0,01% 2/9/2030 | 20.185 | 0,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | |
| EUR 15.705.000 | Bundesobligation RegS 2,20% 13/4/2028 [^] | 15.648.619 | 2,36 | EUR 1.128.000 | State of Hesse RegS 25/4/2025 (Zero Coupon) | 1.061.019 | 0,16 |
| EUR 9.739.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 2,30% 15/2/2033 | 9.768.120 | 1,47 | EUR 776.000 | State of Lower Saxony RegS 0,125% 7/3/2025 | 734.888 | 0,11 |
| EUR 10.615.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,00% 15/5/2038 | 8.677.444 | 1,31 | EUR 637.000 | State of Lower Saxony RegS 0,125% 8/4/2027 | 571.574 | 0,09 |
| EUR 625.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 3,25% 4/7/2042 | 696.375 | 0,10 | EUR 2.146.000 | State of Lower Saxony RegS 0,01% 25/11/2027 | 1.885.519 | 0,28 |
| EUR 2.880.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,80% 15/8/2053 | 2.477.722 | 0,37 | EUR 840.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,50% 16/2/2027 | 767.105 | 0,12 |
| EUR 15.440.000 | Bundesschatzanweisungen RegS 2,50% 13/3/2025 [^] | 15.375.461 | 2,32 | EUR 1.159.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,60% 4/6/2041 | 744.495 | 0,11 |
| EUR 338.000 | Commerzbank AG 0,05% 9/5/2029 | 283.670 | 0,04 | EUR 64.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,375% 2/9/2050 | 31.379 | 0,00 |
| EUR 100.000 | Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023 | 99.098 | 0,01 | EUR 630.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,50% 15/1/2052 | 316.102 | 0,05 |
| EUR 600.000 | Commerzbank AG RegS FRN 18/1/2030 | 599.574 | 0,09 | EUR 565.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 3,40% 7/3/2073 | 583.690 | 0,09 |
| EUR 600.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS FRN 31/12/2099 [^] | 478.692 | 0,07 | EUR 200.000 | Vonovia SE RegS 5,00% 23/11/2030 | 192.388 | 0,03 |
| EUR 800.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 23/2/2028 | 710.288 | 0,11 | | | 82.168.901 | 12,38 |
| EUR 1.400.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 11/1/2029 [^] | 1.391.838 | 0,21 | | Irland | | |
| EUR 700.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 5/9/2030 | 677.194 | 0,10 | GBP 381.857 | Agora Securities UK '2021-1X A' DAC RegS FRN 22/7/2031 | 428.320 | 0,06 |
| EUR 400.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 17/1/2025 | 367.248 | 0,06 | EUR 100.000 | AIB Group Plc RegS FRN 17/11/2027 | 87.762 | 0,01 |
| EUR 1.700.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 1.504.721 | 0,23 | EUR 1.250.000 | AIB Group Plc RegS FRN 23/7/2029 | 1.233.938 | 0,19 |
| EUR 600.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023 | 594.930 | 0,09 | EUR 550.841 | Haus European Loan Conduit '39X A1' DAC RegS FRN 28/7/2051 | 517.790 | 0,08 |
| EUR 200.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,50% 18/4/2028 | 181.942 | 0,03 | EUR 140.959 | Haus European Loan Conduit '39X C' DAC RegS FRN 28/7/2051 | 121.930 | 0,02 |
| EUR 900.000 | Hannover Rueck SE RegS FRN 26/8/2043 | 937.116 | 0,14 | EUR 1.550.000 | Ireland Government Bond RegS 1,00% 15/5/2026 | 1.477.708 | 0,22 |
| EUR 1.000.000 | Heidelberg Materials AG RegS 3,75% 31/5/2032 | 967.260 | 0,15 | EUR 1.850.000 | Ireland Government Bond RegS 18/10/2031 (Zero Coupon) | 1.480.869 | 0,22 |
| EUR 100.000 | ING-DiBa AG RegS 0,01% 7/10/2028 | 85.212 | 0,01 | EUR 1.270.000 | Ireland Government Bond RegS 1,30% 15/5/2033 | 1.106.437 | 0,17 |
| EUR 12.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,05% 30/5/2024 | 11.634 | 0,00 | EUR 300.000 | Ireland Government Bond RegS 1,70% 15/5/2037 | 252.516 | 0,04 |
| EUR 60.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,50% 15/9/2027 | 54.335 | 0,01 | EUR 230.000 | Ireland Government Bond RegS 0,55% 22/4/2041 | 148.118 | 0,02 |
| EUR 153.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 30/9/2026 (Zero Coupon) | 139.180 | 0,02 | EUR 631.000 | Ireland Government Bond RegS 3,00% 18/10/2043 | 613.218 | 0,09 |
| EUR 304.000 | Landwirtschaftliche Rentenbank RegS 0,05% 12/6/2023 | 303.760 | 0,05 | EUR 65.000 | Ireland Government Bond RegS 2,00% 18/2/2045 | 52.620 | 0,01 |
| EUR 1.000.000 | NRW Bank 15/10/2029 (Zero Coupon) | 830.960 | 0,13 | EUR 540.000 | Ireland Government Bond RegS 1,50% 15/5/2050 | 371.952 | 0,06 |
| EUR 26.000 | NRW Bank 18/2/2030 (Zero Coupon) | 21.378 | 0,00 | EUR 564.565 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC '1X A' RegS FRN 17/8/2033 | 539.865 | 0,08 |
| EUR 421.000 | NRW Bank 0,10% 9/7/2035 | 294.014 | 0,04 | EUR 144.333 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC '1X C' RegS FRN 17/8/2033 | 128.217 | 0,02 |
| EUR 316.000 | NRW Bank RegS 0,875% 10/11/2025 | 298.708 | 0,05 | EUR 98.186 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC '1X D' RegS FRN 17/8/2033 | 87.588 | 0,01 |
| EUR 405.000 | NRW Bank RegS 0,625% 2/2/2029 | 356.210 | 0,05 | EUR 499.897 | Last Mile Securities PE '2021- 1X A1' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 483.993 | 0,07 |
| EUR 2.177.000 | NRW Bank RegS 0,25% 26/1/2032 | 1.733.414 | 0,26 | EUR 200.000 | LT Autorahoitus '3 B' DAC RegS FRN 17/12/2032 | 202.140 | 0,03 |
| EUR 826.000 | NRW Bank RegS 0,50% 17/6/2041 | 526.269 | 0,08 | | | | |
| EUR 87.011 | Red & Black Auto Germany '8 C' UG RegS FRN 15/9/2030 | 85.434 | 0,01 | | | | |
| EUR 1.400.000 | Robert Bosch GmbH RegS 4,375% 2/6/2043 | 1.442.686 | 0,22 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------|--|------------------------|--------------------|----------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Irland Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| EUR 100.000 | Lt Autorahoitus '4 B' DAC RegS FRN 18/7/2033 | 100.234 | 0,02 | EUR 20.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,00% 1/9/2040 | 21.374 | 0,00 |
| GBP 343.939 | Taurus '2021-UK4X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 381.852 | 0,06 | EUR 1.705.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,75% 1/9/2044 | 1.763.601 | 0,27 |
| GBP 296.013 | Taurus '2021-UK4X C' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 323.451 | 0,05 | EUR 4.272.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045 | 2.557.903 | 0,39 |
| GBP 98.482 | Taurus '2021-UK4X D' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 105.601 | 0,02 | EUR 1.677.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,85% 1/9/2049 | 1.515.220 | 0,23 |
| EUR 849.806 | Vita Scientia '2022-1X A' DAC RegS FRN 27/2/2033 | 822.187 | 0,12 | EUR 2.925.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,50% 1/10/2053 | 2.885.513 | 0,44 |
| | | 11.068.306 | 1,67 | EUR 280.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,80% 1/3/2067 | 191.086 | 0,03 |
| Italien | | | | EUR 1.379.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS (traded in Germany) 0,50% 1/2/2026 | 1.278.816 | 0,19 |
| EUR 950.000 | A2A SpA RegS 4,375% 3/2/2034^ | 947.293 | 0,14 | EUR 4.971.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS (traded in Italy) 0,50% 1/2/2026 | 4.609.857 | 0,69 |
| EUR 249.868 | Autoflorence '2 B' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 245.539 | 0,04 | EUR 473.930 | Koromo Italy '1 A' Srl RegS FRN 26/2/2035 | 474.726 | 0,07 |
| EUR 77.840 | Autoflorence '2 C' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 75.335 | 0,01 | EUR 142.000 | Red & Black Auto Italy '1 D' Srl RegS FRN 28/12/2031 | 136.424 | 0,02 |
| EUR 77.840 | Autoflorence '2 D' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 75.994 | 0,01 | EUR 500.000 | UniCredit SpA RegS FRN 18/1/2028 | 442.625 | 0,07 |
| EUR 100.000 | AutoFlorence '3 B' Srl RegS FRN 25/12/2046 | 100.000 | 0,02 | EUR 485.000 | UniCredit SpA RegS FRN 23/9/2029 | 456.385 | 0,07 |
| EUR 138.000 | Brignole Co '2021 B' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 136.549 | 0,02 | | | 66.711.905 | 10,05 |
| EUR 199.523 | Cassia '2022-1X B' Srl RegS FRN 22/5/2034 | 184.718 | 0,03 | Japan | | | |
| EUR 1.300.000 | Credit Agricole Italia SpA RegS 0,125% 15/3/2033^ | 928.460 | 0,14 | EUR 900.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd RegS 3,629% 6/4/2026 | 898.128 | 0,14 |
| EUR 450.000 | Credito Emiliano SpA RegS 1,125% 17/1/2024 | 442.323 | 0,07 | | | 898.128 | 0,14 |
| EUR 800.000 | Enel SpA RegS FRN 31/12/2099 | 805.448 | 0,12 | Lettland | | | |
| EUR 300.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024 | 292.806 | 0,04 | EUR 350.000 | Latvia Government International Bond RegS 3,50% 17/1/2028 | 348.826 | 0,05 |
| EUR 4.220.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,50% 15/1/2026 | 4.232.491 | 0,64 | | | 348.826 | 0,05 |
| EUR 2.590.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,80% 15/4/2026 | 2.616.340 | 0,39 | Litauen | | | |
| EUR 2.200.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,10% 1/4/2027 | 2.018.236 | 0,30 | EUR 600.000 | Lithuania Government International Bond RegS 2,125% 1/6/2032^ | 527.514 | 0,08 |
| EUR 2.975.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,05% 1/8/2027 | 2.816.135 | 0,42 | | | 527.514 | 0,08 |
| EUR 2.950.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,65% 1/12/2027 | 2.848.432 | 0,43 | Luxemburg | | | |
| EUR 2.340.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,40% 1/4/2028 | 2.326.826 | 0,35 | EUR 500.000 | BL Consumer Credit '2021-1 E' RegS FRN 25/9/2038 | 481.933 | 0,07 |
| EUR 420.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,50% 15/7/2028 | 360.713 | 0,05 | EUR 700.000 | Bumper De SA '2023-DE1 A' RegS FRN 23/8/2032 | 701.036 | 0,11 |
| EUR 3.438.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,75% 1/9/2028 | 3.632.109 | 0,55 | EUR 168.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,20% 28/4/2025 | 158.883 | 0,02 |
| EUR 615.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,50% 1/3/2030 | 607.546 | 0,09 | EUR 3.653.000 | European Financial Stability Facility RegS 15/10/2025 (Zero Coupon) | 3.401.527 | 0,51 |
| EUR 450.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,35% 1/4/2030 | 385.371 | 0,06 | EUR 687.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,40% 31/5/2026 | 636.828 | 0,10 |
| EUR 1.082.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,00% 30/10/2031 | 1.090.353 | 0,16 | EUR 418.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,75% 3/5/2027 | 384.961 | 0,06 |
| EUR 5.345.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,40% 1/5/2033^ | 5.499.791 | 0,83 | EUR 5.855.000 | European Financial Stability Facility RegS 3,00% 15/12/2028 | 5.878.713 | 0,89 |
| EUR 9.419.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,00% 30/4/2035 | 9.193.980 | 1,39 | EUR 3.901.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,05% 17/10/2029 | 3.262.718 | 0,49 |
| EUR 248.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,25% 1/9/2036 | 197.403 | 0,03 | EUR 1.288.000 | European Financial Stability Facility RegS 20/1/2031 (Zero Coupon) | 1.033.955 | 0,16 |
| EUR 2.885.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,00% 1/2/2037 | 2.792.247 | 0,42 | | | | |
| EUR 2.480.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,25% 1/3/2038 | 2.177.514 | 0,33 | | | | |
| EUR 1.429.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,95% 1/9/2038 | 1.207.119 | 0,18 | | | | |
| EUR 2.068.693 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,40% 15/5/2039 | 2.141.304 | 0,32 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|------------------------------|---|------------------------|--------------------|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Luxemburg Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| EUR 74.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,875% 10/4/2035 | 57.676 | 0,01 | EUR 200.000 | Green STORM '2023-GRN A' BV RegS FRN 22/2/2070 | 200.277 | 0,03 |
| EUR 15.000 | European Financial Stability Facility RegS 1,20% 17/2/2045 | 10.342 | 0,00 | EUR 1.100.000 | ING Bank NV RegS 0,50% 17/2/2027 | 998.184 | 0,15 |
| EUR 1.360.000 | European Financial Stability Facility RegS 1,80% 10/7/2048 | 1.014.873 | 0,15 | EUR 1.300.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 1.235.897 | 0,19 |
| EUR 183.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,70% 20/1/2050 | 99.876 | 0,01 | EUR 400.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2027 | 368.568 | 0,06 |
| EUR 460.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,05% 18/1/2052 | 185.375 | 0,03 | EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 1/2/2030 | 159.318 | 0,02 |
| EUR 300.000 | European Financial Stability Facility RegS 0,70% 17/1/2053 | 153.519 | 0,02 | EUR 500.000 | ING Groep NV RegS FRN 24/8/2033 | 477.600 | 0,07 |
| EUR 2.207.000 | Nestle Finance International Ltd RegS 14/6/2026 (Zero Coupon) | 2.012.298 | 0,30 | EUR 600.000 | ING Groep NV RegS (traded in Germany) FRN 18/2/2029 | 495.672 | 0,08 |
| EUR 188.000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg RegS 3,00% 2/3/2033 | 190.036 | 0,03 | EUR 500.000 | ING Groep NV RegS (traded in International) FRN 18/2/2029 | 413.060 | 0,06 |
| EUR 172.000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg RegS 3,25% 2/3/2043 | 175.466 | 0,03 | EUR 215.000 | Jubilee Place '3 B' RegS FRN 17/1/2059 | 208.797 | 0,03 |
| | | 19.840.015 | 2,99 | EUR 100.000 | Jubilee Place '3 C' RegS FRN 17/1/2059 | 95.910 | 0,01 |
| | | | | EUR 100.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 87.670 | 0,01 |
| Niederlande | | | | EUR 2.580.000 | Nederlandse Waterschapsbank NV RegS 3,00% 20/4/2033 | 2.574.711 | 0,39 |
| EUR 1.600.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,375% 20/10/2028 | 1.599.920 | 0,24 | EUR 1.220.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,00% 15/7/2024^ | 1.208.007 | 0,18 |
| EUR 1.800.000 | ABN AMRO Bank NV RegS FRN 22/2/2033 | 1.779.192 | 0,27 | EUR 4.880.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2026 (Zero Coupon) | 4.555.822 | 0,69 |
| EUR 200.000 | Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025 | 186.380 | 0,03 | EUR 1.314.050 | Netherlands Government Bond RegS 0,75% 15/7/2027 | 1.224.248 | 0,18 |
| EUR 600.000 | Achmea Bank NV RegS 3,00% 31/1/2030 | 594.102 | 0,09 | EUR 155.904 | Netherlands Government Bond RegS 5,50% 15/1/2028 | 175.782 | 0,03 |
| EUR 600.000 | Aegon Bank NV RegS 0,01% 16/11/2025 | 551.826 | 0,08 | EUR 1.125.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,25% 15/7/2029 | 982.935 | 0,15 |
| EUR 3.100.000 | BNG Bank NV RegS 3,00% 23/4/2030 | 3.101.674 | 0,47 | EUR 2.010.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,50% 15/7/2033 | 1.985.599 | 0,30 |
| EUR 755.000 | BNG Bank NV RegS 0,125% 19/4/2033 | 569.791 | 0,09 | EUR 4.601.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,50% 15/1/2040 | 3.214.358 | 0,48 |
| EUR 700.000 | BNG Bank NV RegS 0,805% 28/6/2049 | 391.258 | 0,06 | EUR 767.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,75% 15/1/2047 | 772.016 | 0,12 |
| EUR 300.000 | Cooperatieve Rabobank UA RegS 0,875% 8/2/2028 | 271.485 | 0,04 | EUR 1.545.000 | Netherlands Government Bond RegS 2,00% 15/1/2054 | 1.316.726 | 0,20 |
| EUR 200.000 | de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024 | 190.630 | 0,03 | EUR 306.264 | Silver Arrow Athlon NL '2021-1 A' BV RegS FRN 26/4/2031 | 306.872 | 0,05 |
| EUR 1.700.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 1.597.235 | 0,24 | EUR 570.000 | TenneT Holding BV RegS 4,50% 28/10/2034 | 612.391 | 0,09 |
| EUR 431.607 | Domi '2021-1 A' BV RegS FRN 15/6/2053 | 428.514 | 0,06 | EUR 2.900.000 | TenneT Holding BV RegS FRN 31/12/2099^ | 2.858.269 | 0,43 |
| EUR 603.293 | Dutch Property Finance '2021-2 A' BV RegS FRN 28/4/2059 | 600.498 | 0,09 | EUR 300.000 | Universal Music Group NV RegS (traded in Germany) 3,75% 30/6/2032 | 294.924 | 0,04 |
| EUR 207.000 | Dutch Property Finance '2021-2 B' BV RegS FRN 28/4/2059 | 202.153 | 0,03 | EUR 500.000 | Universal Music Group NV RegS (traded in International) 3,75% 30/6/2032 | 491.540 | 0,07 |
| EUR 120.000 | Dutch Property Finance '2021-2 C' BV RegS FRN 28/4/2059 | 115.273 | 0,02 | EUR 900.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,00% 9/7/2030^ | 685.485 | 0,10 |
| EUR 705.898 | Dutch Property Finance '2023-1 A' BV RegS FRN 28/4/2064 | 706.234 | 0,11 | | | 43.818.046 | 6,60 |
| EUR 200.000 | EDP Finance BV RegS 3,875% 11/3/2030 | 201.210 | 0,03 | Neuseeland | | | |
| EUR 850.000 | Enel Finance International NV RegS 17/6/2024 (Zero Coupon) | 817.887 | 0,12 | EUR 382.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031 | 298.984 | 0,05 |
| EUR 150.000 | Enel Finance International NV RegS 1,50% 21/7/2025 | 143.971 | 0,02 | EUR 495.000 | Australia & New Zealand International Ltd RegS 0,125% 22/9/2023 | 490.005 | 0,07 |
| USD 1.390.000 | Enel Finance International NV RegS 7,50% 14/10/2032^ | 1.445.730 | 0,22 | | | | |
| EUR 325.000 | Enexis Holding NV RegS 1,50% 20/10/2023 | 322.445 | 0,05 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Neuseeland Fortsetzung | | | | Portugal Fortsetzung | | |
| EUR 575.000 | Chorus Ltd 3,625% 7/9/2029 | 563.316 | 0,09 | EUR 210.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052 | 111.894 | 0,02 |
| EUR 807.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 | 798.648 | 0,12 | EUR 330.051 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance '2 D' RegS FRN 23/9/2038 | 304.934 | 0,05 |
| EUR 600.000 | Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026 | 537.714 | 0,08 | EUR 157.540 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Viriato Finance '1 B' RegS FRN 28/10/2040 | 150.878 | 0,02 |
| | | 2.688.667 | 0,41 | EUR 236.309 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Viriato Finance '1 C' RegS FRN 28/10/2040 | 225.062 | 0,03 |
| | Norwegen | | | | | 11.241.505 | 1,69 |
| EUR 1.250.000 | DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023 | 1.229.737 | 0,18 | | Singapur | | |
| EUR 850.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 21/9/2027 | 832.873 | 0,13 | USD 1.015.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,30% 19/5/2053 | 969.282 | 0,15 |
| EUR 1.452.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 19/6/2025^ | 1.371.719 | 0,21 | | | 969.282 | 0,15 |
| EUR 1.113.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,01% 21/1/2031 | 877.111 | 0,13 | | Slowakei | | |
| EUR 725.000 | Eika Boligkreditt AS RegS 2,50% 22/9/2028^ | 700.879 | 0,11 | EUR 800.000 | Slovakia Government Bond RegS 1,00% 14/5/2032^ | 650.750 | 0,10 |
| EUR 873.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025 | 830.581 | 0,12 | EUR 1.928.687 | Slovakia Government Bond RegS 4,00% 23/2/2043 | 1.912.250 | 0,29 |
| EUR 1.625.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 1,75% 25/5/2027 | 1.534.812 | 0,23 | EUR 350.000 | Slovakia Government Bond RegS 2,00% 17/10/2047 | 249.351 | 0,04 |
| EUR 3.923.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,01% 22/9/2027^ | 3.419.914 | 0,51 | EUR 100.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024 | 97.148 | 0,01 |
| EUR 2.400.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,05% 3/11/2028 | 2.027.112 | 0,31 | EUR 500.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 23/6/2025 | 462.431 | 0,07 |
| EUR 600.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 3,00% 19/5/2030 | 593.184 | 0,09 | | | 3.371.930 | 0,51 |
| EUR 150.000 | Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon) | 148.232 | 0,02 | | Slowenien | | |
| EUR 330.000 | Telenor ASA RegS 2,50% 22/5/2025^ | 323.417 | 0,05 | EUR 400.000 | Slovenia Government Bond RegS 0,275% 14/1/2030 | 332.748 | 0,05 |
| | | 13.889.571 | 2,09 | EUR 470.000 | Slovenia Government Bond RegS 0,875% 15/7/2030^ | 403.598 | 0,06 |
| | Polen | | | EUR 845.000 | Slovenia Government Bond RegS 0,488% 20/10/2050 | 407.096 | 0,06 |
| EUR 98.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 1,00% 25/10/2028^ | 85.518 | 0,01 | | | 1.143.442 | 0,17 |
| EUR 725.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 2,75% 25/5/2032 | 658.180 | 0,10 | | Spanien | | |
| | | 743.698 | 0,11 | EUR 281.278 | Autonomia Spain '2021-SP B' FT RegS FRN 31/1/2039 | 278.063 | 0,04 |
| | Portugal | | | EUR 70.319 | Autonomia Spain '2021-SP D' FT RegS FRN 31/1/2039 | 68.339 | 0,01 |
| EUR 60.338 | Ares Lusitani-STC SA / Pelican Finance '2 C' RegS FRN 25/1/2035 | 58.887 | 0,01 | EUR 70.320 | Autonomia Spain '2021-SP E' FT RegS FRN 31/1/2039 | 67.181 | 0,01 |
| EUR 241.351 | Ares Lusitani-STC SA / Pelican Finance '2 D' RegS FRN 25/1/2035 | 230.642 | 0,03 | EUR 70.320 | Autonomia Spain '2021-SP E' FT RegS FRN 31/1/2039 | 66.544 | 0,01 |
| EUR 2.300.000 | Banco Santander Totta SA RegS 3,375% 19/4/2028^ | 2.293.698 | 0,35 | EUR 1.200.000 | Banco de Sabadell SA RegS 1,00% 26/4/2027 | 1.096.224 | 0,17 |
| EUR 435.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,95% 25/10/2023 | 437.875 | 0,07 | EUR 400.000 | Banco de Sabadell SA RegS 0,125% 10/2/2028^ | 344.044 | 0,05 |
| EUR 885.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 5,65% 15/2/2024^ | 901.966 | 0,14 | EUR 400.000 | Banco Santander SA RegS 3,375% 11/1/2026 | 398.956 | 0,06 |
| EUR 1.085.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 2,875% 15/10/2025 | 1.090.219 | 0,16 | EUR 4.300.000 | Banco Santander SA RegS 2,375% 8/9/2027 | 4.139.524 | 0,62 |
| EUR 2.040.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,125% 14/4/2027 | 2.153.547 | 0,32 | EUR 1.200.000 | Banco Santander SA RegS 0,125% 4/6/2030 | 959.880 | 0,14 |
| EUR 3.164.000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 3,50% 18/6/2038 | 3.183.079 | 0,48 | EUR 500.000 | Banco Santander SA RegS 0,875% 9/5/2031^ | 414.080 | 0,06 |
| EUR 91.200 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,10% 15/2/2045 | 98.824 | 0,01 | EUR 500.000 | CaixaBank SA RegS FRN 18/11/2026 | 452.770 | 0,07 |
| | | | | EUR 100.000 | CaixaBank SA RegS FRN 14/11/2030 | 103.311 | 0,02 |
| | | | | EUR 1.600.000 | Iberdrola Finanzas SA RegS FRN 25/1/2030 | 1.553.216 | 0,23 |
| | | | | EUR 800.000 | Spain Government Bond 31/5/2024 (Zero Coupon) | 775.232 | 0,12 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------------------|---|------------------------|--------------------|--|---|------------------------|--------------------|
| Spanien Fortsetzung | | | | Supranationale Anleihen Fortsetzung | | | |
| EUR 1.650.000 | Spain Government Bond 31/1/2025 (Zero Coupon) | 1.571.922 | 0,24 | EUR 1.350.000 | European Stability Mechanism RegS 1,85% 1/12/2055 | 958.743 | 0,14 |
| EUR 2.200.000 | Spain Government Bond 31/1/2026 (Zero Coupon) | 2.035.968 | 0,31 | EUR 8.200.000 | European Union RegS 0,80% 4/7/2025 | 7.825.014 | 1,18 |
| EUR 6.005.000 | Spain Government Bond 31/1/2027 (Zero Coupon) | 5.396.633 | 0,81 | EUR 7.606.000 | European Union RegS 2,75% 4/2/2033 | 7.462.855 | 1,12 |
| EUR 2.000.000 | Spain Government Bond 31/1/2028 (Zero Coupon) | 1.746.240 | 0,26 | EUR 559.000 | European Union RegS 4/7/2035 (Zero Coupon) | 385.839 | 0,06 |
| EUR 1.100.000 | Spain Government Bond (traded in Germany) 0,80% 30/7/2029 | 962.951 | 0,14 | EUR 4.729.000 | European Union RegS 0,40% 4/2/2037 | 3.282.730 | 0,49 |
| EUR 1.700.000 | Spain Government Bond (traded in Spain) 0,80% 30/7/2029 | 1.488.197 | 0,22 | EUR 1.730.000 | European Union RegS 0,45% 4/7/2041 | 1.062.012 | 0,16 |
| EUR 1.065.000 | Spain Government Bond RegS 4,80% 31/1/2024 | 1.075.586 | 0,16 | EUR 2.610.000 | European Union RegS 3,375% 4/11/2042 | 2.614.098 | 0,39 |
| EUR 2.116.000 | Spain Government Bond RegS 2,75% 31/10/2024^ | 2.113.228 | 0,32 | EUR 2.170.000 | European Union RegS 2,625% 4/2/2048 | 1.916.305 | 0,29 |
| EUR 1.225.000 | Spain Government Bond RegS 1,40% 30/4/2028 | 1.139.042 | 0,17 | EUR 1.100.000 | European Union RegS 0,70% 6/7/2051^ | 587.972 | 0,09 |
| EUR 2.433.000 | Spain Government Bond RegS 2,55% 31/10/2032 | 2.293.103 | 0,35 | EUR 3.781.000 | European Union RegS 2,50% 4/10/2052 | 3.168.818 | 0,48 |
| EUR 11.360.000 | Spain Government Bond RegS 3,15% 30/4/2033 | 11.190.963 | 1,69 | EUR 1.180.000 | European Union RegS 3,00% 4/3/2053 | 1.093.801 | 0,16 |
| EUR 3.108.000 | Spain Government Bond RegS 3,90% 30/7/2039 | 3.163.136 | 0,48 | | | 42.842.501 | 6,45 |
| EUR 740.000 | Spain Government Bond RegS 4,90% 30/7/2040 | 848.869 | 0,13 | Schweden | | | |
| EUR 117.000 | Spain Government Bond RegS 4,70% 30/7/2041 | 131.201 | 0,02 | EUR 100.000 | Lansforsakringar Hypotek AB RegS 0,625% 29/1/2026 | 93.007 | 0,02 |
| EUR 587.000 | Spain Government Bond RegS 1,00% 30/7/2042 | 366.505 | 0,06 | EUR 600.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 3/11/2031 | 516.738 | 0,08 |
| EUR 2.884.000 | Spain Government Bond RegS 3,45% 30/7/2043 | 2.715.488 | 0,41 | EUR 945.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024 | 908.391 | 0,14 |
| EUR 960.000 | Spain Government Bond RegS 5,15% 31/10/2044 | 1.141.757 | 0,17 | EUR 1.800.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 1,375% 23/2/2029^ | 1.547.514 | 0,23 |
| EUR 4.500.000 | Spain Government Bond RegS 1,90% 31/10/2052 | 2.906.505 | 0,44 | EUR 450.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,50% 18/2/2030 | 355.365 | 0,05 |
| EUR 311.000 | Spain Government Bond RegS 3,45% 30/7/2066 | 276.096 | 0,04 | EUR 3.105.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 2.796.518 | 0,42 |
| | | 53.280.754 | 8,03 | EUR 1.150.000 | Swedbank AB RegS FRN 20/5/2027 | 1.019.279 | 0,15 |
| | | | | EUR 300.000 | Telia Co AB RegS 3,625% 22/2/2032 | 300.708 | 0,05 |
| | | | | | | 7.537.520 | 1,14 |
| | | | | Schweiz | | | |
| | | | | EUR 400.000 | African Development Bank 0,50% 21/3/2029 | 347.506 | 0,05 |
| | | | | EUR 933.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 13/10/2026 | 867.130 | 0,13 |
| | | | | EUR 433.000 | European Investment Bank 0,10% 15/10/2026 | 394.623 | 0,06 |
| | | | | EUR 2.598.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 2.219.601 | 0,34 |
| | | | | EUR 1.828.000 | European Investment Bank 0,20% 17/3/2036 | 1.270.442 | 0,19 |
| | | | | EUR 1.262.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 1/3/2029 | 1.398.675 | 0,21 |
| | | | | EUR 2.400.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 2.073.600 | 0,31 |
| | | | | EUR 45.000 | European Investment Bank RegS 0,375% 15/5/2026 | 41.767 | 0,01 |
| | | | | EUR 664.000 | UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026 | 611.571 | 0,09 |
| | | | | EUR 56.000 | European Investment Bank RegS 0,875% 14/1/2028 | 51.282 | 0,01 |
| | | | | EUR 200.000 | Zuercher Kantonalbank RegS FRN 13/4/2028 | 183.298 | 0,03 |
| | | | | | | 7.353.875 | 1,11 |
| | | | | Großbritannien | | | |
| | | | | EUR 3.839.000 | European Investment Bank RegS 2,75% 30/7/2030^ | 3.809.785 | 0,57 |
| | | | | EUR 966.000 | Anglo American Capital Plc RegS 5,00% 15/3/2031^ | 994.941 | 0,15 |
| | | | | EUR 900.000 | European Investment Bank RegS 1,50% 15/6/2032 | 799.380 | 0,12 |
| | | | | GBP 581.000 | Atlas Funding '2023-1 A' Plc RegS FRN 20/1/2063 | 674.353 | 0,10 |
| | | | | EUR 2.377.000 | European Investment Bank RegS 0,25% 15/6/2040^ | 1.459.335 | 0,22 |
| | | | | GBP 197.000 | Atlas Funding '2023-1 B' Plc RegS FRN 20/1/2061 | 228.453 | 0,03 |
| | | | | EUR 70.000 | European Investment Bank RegS 1,00% 14/11/2042 | 47.452 | 0,01 |
| | | | | GBP 100.000 | Atlas Funding '2023-1 C' Plc RegS FRN 20/1/2061 | 115.965 | 0,02 |
| | | | | EUR 172.254 | European Stability Mechanism RegS 14/3/2025 (Zero Coupon) | 162.930 | 0,02 |
| | | | | EUR 2.675.000 | Barclays Plc RegS FRN 29/1/2034 | 2.710.925 | 0,41 |
| | | | | GBP 100.000 | Barley Hill '2 B' Plc RegS FRN 27/8/2058 | 113.710 | 0,02 |
| | | | | EUR 114.000 | European Stability Mechanism RegS 0,75% 15/3/2027 | 105.221 | 0,02 |
| | | | | EUR 125.000 | European Stability Mechanism RegS 0,75% 5/9/2028 | 112.059 | 0,02 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | |
| EUR 150.000 | BP Capital Markets Plc RegS 1,231% 8/5/2031 | 124.169 | 0,02 | GBP 100.000 | Hops Hill '2 C' Plc RegS FRN 27/11/2054 | 114.774 | 0,02 |
| GBP 490.909 | Brass '11X A1' Plc RegS FRN 16/11/2070 | 573.867 | 0,09 | GBP 148.000 | Hops Hill '3 C' Plc RegS FRN 21/12/2055 | 167.026 | 0,02 |
| EUR 795.000 | British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024' | 765.283 | 0,11 | EUR 2.375.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 10/3/2032 | 2.404.688 | 0,36 |
| EUR 1.056.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030 | 851.801 | 0,13 | EUR 915.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 16/11/2032 | 944.555 | 0,14 |
| GBP 113.000 | Canada Square Funding '2021- 2 B' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 128.197 | 0,02 | GBP 100.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 C' Plc RegS FRN 20/7/2058 | 110.973 | 0,02 |
| GBP 100.000 | Canada Square Funding '2021- 2 C' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 113.167 | 0,02 | GBP 291.885 | London Wall Mortgage Capital '2021-FL1 A' Plc RegS FRN 15/5/2051 | 334.774 | 0,05 |
| GBP 115.000 | Canada Square Funding '6 C' Plc RegS FRN 17/1/2059 | 127.453 | 0,02 | GBP 100.000 | Mortimer BTL '2021-1 C' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 109.965 | 0,02 |
| GBP 130.000 | Canada Square Funding '6 D' Plc RegS FRN 17/1/2059 | 139.518 | 0,02 | EUR 850.000 | National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc RegS 3,53% 20/9/2028 | 836.358 | 0,13 |
| EUR 800.000 | Diageo Finance Plc RegS 0,125% 12/10/2023 | 790.536 | 0,12 | EUR 527.000 | National Grid Electricity Transmission Plc RegS 0,823% 7/7/2032 | 406.227 | 0,06 |
| GBP 200.000 | Dowson '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 231.465 | 0,03 | EUR 700.000 | National Grid Plc RegS 0,25% 1/9/2028 | 586.292 | 0,09 |
| GBP 200.000 | Dowson '2021-2 C' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 229.853 | 0,03 | EUR 891.000 | National Grid Plc RegS 2,949% 30/3/2030 | 834.520 | 0,12 |
| GBP 103.000 | Dowson '2022-1 B' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 119.507 | 0,02 | EUR 2.550.000 | Nationwide Building Society RegS 3,625% 15/3/2028 | 2.588.938 | 0,39 |
| GBP 520.000 | Economic Master Issuer '2021- 1X A' Plc RegS FRN 25/6/2073 | 600.422 | 0,09 | EUR 279.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 | 229.695 | 0,03 |
| GBP 301.150 | Economic Master Issuer '2023- 1 A' Plc RegS FRN 25/6/2074 | 350.178 | 0,05 | EUR 400.000 | NatWest Markets Plc RegS 4,25% 13/1/2028 | 402.152 | 0,06 |
| GBP 143.463 | Elvet Mortgages '2020-1 A' Plc RegS FRN 22/3/2065 | 166.569 | 0,02 | GBP 136.000 | Newday Funding Master Issuer Plc - Series '2021-3X B' RegS FRN 15/11/2029 | 155.442 | 0,02 |
| GBP 551.882 | Elvet Mortgages '2021-1 A' Plc RegS FRN 22/10/2063 | 637.893 | 0,10 | GBP 259.577 | Parkmore Point RMBS '2022- 1X A' Plc RegS FRN 25/7/2045 | 300.627 | 0,04 |
| GBP 481.088 | Finsbury Square '2021-1GRX AGRN' RegS FRN 16/12/2067 | 551.553 | 0,08 | GBP 802.000 | PCL Funding VIII '2023-1 A' Plc RegS FRN 15/5/2028 | 930.755 | 0,14 |
| GBP 272.000 | Finsbury Square '2021-1GRX B' RegS FRN 16/12/2067 | 309.041 | 0,05 | GBP 148.000 | PCL Funding VIII '2023-1 B' Plc RegS FRN 15/5/2028 | 171.649 | 0,02 |
| GBP 233.000 | Finsbury Square '2021-1GRX C' RegS FRN 16/12/2067 | 262.232 | 0,04 | GBP 400.000 | Pierpont BTL '2021-1 B' Plc RegS FRN 22/12/2053 | 450.316 | 0,07 |
| GBP 720.214 | Finsbury Square '2021-2X A' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 828.305 | 0,12 | GBP 366.000 | Polaris '2022-1 B' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 417.207 | 0,06 |
| GBP 217.000 | Finsbury Square '2021-2X B' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 246.234 | 0,04 | GBP 136.000 | Polaris '2022-1 D' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 149.300 | 0,02 |
| GBP 109.000 | Finsbury Square '2021-2X C' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 120.354 | 0,02 | GBP 298.000 | Polaris '2022-1 E' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 329.317 | 0,05 |
| GBP 100.000 | Finsbury Square '2021-2X D' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 108.531 | 0,02 | GBP 100.000 | Polaris '2023-1 C' Plc RegS FRN 23/2/2061 | 115.993 | 0,02 |
| GBP 13.312 | Gemgarto '2021-1X X' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 15.440 | 0,00 | EUR 5.900.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 25/8/2028 | 5.602.699 | 0,84 |
| EUR 250.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon) | 247.360 | 0,04 | EUR 1.675.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 1.349.816 | 0,20 |
| EUR 206.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 2/12/2024 | 200.265 | 0,03 | EUR 125.000 | Santander UK Plc 0,10% 12/5/2024 | 120.763 | 0,02 |
| GBP 389.000 | Harben Finance '2017-1RX B' RegS FRN 28/9/2055 | 435.046 | 0,06 | GBP 184.000 | Satus '2021-1 B' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 213.182 | 0,03 |
| GBP 181.000 | Harben Finance '2017-1RX C' RegS FRN 28/9/2055 | 198.910 | 0,03 | GBP 226.000 | Satus '2021-1 C' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 259.711 | 0,04 |
| GBP 179.000 | Harben Finance '2017-1RX D' RegS FRN 28/9/2055 | 187.208 | 0,03 | GBP 100.000 | Satus '2021-1 D' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 113.149 | 0,02 |
| GBP 401.000 | Holmes Master Issuer '2023-1X A1' Plc RegS FRN 15/10/2072 | 466.752 | 0,07 | GBP 142.000 | Satus '2021-1 E' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 156.968 | 0,02 |
| GBP 100.000 | Hops Hill '2 B' Plc RegS FRN 27/11/2054 | 114.907 | 0,02 | EUR 1.668.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099' | 1.531.591 | 0,23 |
| | | | | GBP 100.000 | Stanlington '2 E' Plc RegS FRN 12/6/2045 | 110.040 | 0,02 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| EUR 2.650.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,375% 18/1/2031 | 2.658.586 | 0,40 | EUR 300.000 | AT&T Inc 4,30% 18/11/2034 | 306.057 | 0,04 |
| GBP 100.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 112.390 | 0,02 | USD 1.700.000 | Bank of America Corp FRN 25/4/2034 | 1.580.851 | 0,24 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 114.134 | 0,02 | EUR 2.300.000 | Bank of America Corp RegS FRN 24/8/2028 | 1.981.505 | 0,30 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2021-2 D' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 108.660 | 0,02 | EUR 100.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 53.273 | 0,01 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X B' Plc RegS FRN 20/12/2063 | 113.853 | 0,02 | EUR 1.250.000 | Global Payments Inc 4,875% 17/3/2031 | 1.266.271 | 0,19 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X C' Plc RegS FRN 20/12/2063 | 111.141 | 0,02 | EUR 3.100.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 2.567.234 | 0,39 |
| GBP 387.000 | Tower Bridge Funding '2023-1X A' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 451.444 | 0,07 | EUR 2.090.000 | International Business Machines Corp 3,75% 6/2/2035 | 2.048.549 | 0,31 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2023-1X C' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 116.217 | 0,02 | EUR 200.000 | Morgan Stanley FRN 26/7/2024 | 199.132 | 0,03 |
| GBP 445.065 | Twin Bridges '2021-2 A' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 509.835 | 0,08 | EUR 2.500.000 | Morgan Stanley FRN 2/3/2029 | 2.544.077 | 0,38 |
| GBP 137.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 153.439 | 0,02 | EUR 1.200.000 | Morgan Stanley FRN 25/1/2034 | 1.259.388 | 0,19 |
| GBP 100.000 | Twin Bridges '2021-2 D' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 107.078 | 0,02 | EUR 325.000 | National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023 | 323.291 | 0,05 |
| GBP 12.283 | Twin Bridges '2021-2 X1' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 14.216 | 0,00 | EUR 590.000 | Verizon Communications Inc 0,375% 22/3/2029 | 492.302 | 0,07 |
| GBP 474.254 | Twin Bridges '2022-1 A' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 543.184 | 0,08 | EUR 2.150.000 | Verizon Communications Inc 4,75% 31/10/2034 | 2.300.621 | 0,35 |
| GBP 263.000 | Twin Bridges '2022-1 B' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 296.705 | 0,04 | | | 17.953.158 | 2,70 |
| GBP 100.000 | Twin Bridges '2022-1 D' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 107.374 | 0,02 | Gesamt Anleihen | | 635.149.141 | 95,69 |
| GBP 100.000 | Twin Bridges '2023-1 C' RegS FRN 14/6/2055 | 115.763 | 0,02 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 635.149.141 | 95,69 |
| GBP 100.000 | Twin Bridges '2023-1 D' RegS FRN 14/6/2055 | 115.731 | 0,02 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| GBP 793.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,00% 22/10/2063 | 847.620 | 0,13 | Irland | | | |
| | | 44.227.195 | 6,66 | 193.591 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)^ | 19.267.308 | 2,90 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | 19.267.308 | 2,90 |
| EUR 225.000 | American Tower Corp 0,875% 21/5/2029 | 184.260 | 0,03 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 19.267.308 | 2,90 |
| EUR 980.000 | American Tower Corp 0,95% 5/10/2030 | 771.417 | 0,11 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 654.416.449 | 98,59 |
| EUR 100.000 | American Tower Corp 1,00% 15/1/2032 | 74.930 | 0,01 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 9.383.662 | 1,41 |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 663.800.111 | 100,00 |
| | | | | ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. ^ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDS | EUR 7.450.000 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (37.082) | (25.306) |
| CCCDS | EUR 12.937.500 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (31.758) | (109.316) |
| CCILS | EUR 910.000 | Fund receives Fixed 2,381% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | (8.068) | (8.049) |
| CCILS | EUR 415.000 | Fund receives Fixed 2,458% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2033 | (958) | (1.409) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|----------------|---|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCILS | EUR 3.130.000 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2032 | (36.462) | (36.397) |
| CCILS | EUR 1.170.000 | Fund receives Fixed 2,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2032 | (22.808) | (22.784) |
| CCILS | EUR 3.808.000 | Fund receives Fixed 2,574% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (4.309) | (4.210) |
| CCILS | EUR 1.390.000 | Fund receives Fixed 2,578% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2032 | (19.503) | (19.474) |
| CCILS | EUR 3.530.000 | Fund receives Fixed 2,601% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2043 | (31.834) | (29.294) |
| CCILS | EUR 975.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,337% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2028 | 3.867 | 3.880 |
| CCILS | EUR 3.490.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,435% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 11.835 | 13.036 |
| CCILS | EUR 3.330.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,700% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2027 | 7.531 | 7.570 |
| CCILS | EUR 1.300.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,720% | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2027 | 17.202 | 17.218 |
| CCILS | EUR 1.610.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,870% | Bank of America Merrill Lynch | 15/11/2027 | 5.240 | 5.259 |
| CCIRS | EUR 1.300.000 | Fund receives Fixed 1,566% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 29/4/2032 | (138.590) | (138.567) |
| CCIRS | EUR 3.620.000 | Fund receives Fixed 2,728% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/4/2033 | 8.597 | 10.622 |
| CCIRS | EUR 3.780.000 | Fund receives Fixed 2,733% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 18/4/2033 | 11.214 | 11.263 |
| CCIRS | EUR 1.160.000 | Fund receives Fixed 2,760% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 6/5/2043 | 991 | 1.018 |
| CCIRS | EUR 3.860.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2033 | 17.380 | 16.707 |
| CCIRS | EUR 1.160.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/5/2043 | 2.214 | 1.855 |
| CCIRS | EUR 3.810.000 | Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2033 | 34.166 | 32.589 |
| CCIRS | GBP 3.880.000 | Fund receives Fixed 4,190% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/4/2026 | (77.320) | (76.957) |
| CCIRS | GBP 970.000 | Fund receives Fixed 4,266% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2026 | (16.861) | (16.847) |
| CCIRS | GBP 9.700.000 | Fund receives Fixed 4,287% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 28/4/2026 | (163.250) | (163.195) |
| CCIRS | GBP 5.980.000 | Fund receives Fixed 4,505% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/5/2025 | (65.028) | (69.977) |
| CCIRS | EUR 1.420.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,193% | Bank of America Merrill Lynch | 4/10/2052 | 114.909 | 114.960 |
| CCIRS | EUR 880.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,668% | Bank of America Merrill Lynch | 4/2/2048 | 7.812 | 7.840 |
| CCIRS | EUR 1.300.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,727% | Bank of America Merrill Lynch | 4/11/2042 | 23.425 | 27.388 |
| CCIRS | EUR 5.900.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,144% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2028 | (45.008) | (44.942) |
| CCIRS | EUR 6.840.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,186% | Bank of America Merrill Lynch | 13/4/2028 | (50.819) | (50.752) |
| CCIRS | USD 11.980.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,639% | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2026 | 73.740 | 73.827 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 115.092.245) | | | | | (409.535) | (472.444) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps

CCILS: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps

CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (62) | USD | 3 Month SOFR Futures September 2023 | Dezember 2023 | 13.771.087 | 119.033 |
| 165 | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 19.460.100 | 115.080 |
| 40 | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 4.625.600 | 67.488 |
| 155 | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 16.329.250 | 199.978 |
| 51 | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 6.921.210 | 7.736 |
| (16) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 2.203.200 | (26.359) |
| (86) | EUR | Euro Schatz Futures June 2023 | Juni 2023 | 9.078.590 | 19.040 |
| 60 | EUR | Euro-OAT Futures June 2023 | Juni 2023 | 7.812.600 | (13.302) |
| (11) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 10.922.006 | (88.867) |
| 51 | GBP | Three Month SONIA Index Futures September 2023 | Dezember 2023 | 13.994.629 | (142.185) |
| 68 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 7.605.313 | 100.402 |
| (60) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 6.759.835 | (35.121) |
| 20 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 2.143.234 | 16.259 |
| (7) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 1.349.992 | (2.056) |
| (1) | USD | US Ultra Bond Futures September 2023 | September 2023 | 127.605 | (2.082) |
| Gesamt | | | | | 335.044 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|---|-------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (10.280.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed annually from 25/8/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 25/8/2024 | Citibank | GBP 4,75 | 25/08/2023 | (55.218) | (99.741) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 7.267.899) | | | | | | (55.218) | (99.741) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|-------------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 1.600.000 | USD | 1.062.019 | Citibank | 21/6/2023 | (23.047) |
| AUD | 1.440.000 | USD | 965.281 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (29.596) |
| CNH | 6.420.000 | USD | 927.455 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | (23.795) |
| EUR | 68.784 | GBP | 60.000 | BNP Paribas | 18/7/2023 | (657) |
| EUR | 1.698.787 | GBP | 1.480.000 | HSBC | 18/7/2023 | (14.088) |
| EUR | 15.824.431 | GBP | 13.990.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | (366.861) |
| EUR | 56.551 | GBP | 50.000 | Natwest Markets | 18/7/2023 | (1.317) |
| EUR | 988.238 | GBP | 860.000 | Royal Bank of Canada | 18/7/2023 | (7.081) |
| EUR | 206.790 | GBP | 180.000 | UBS | 18/7/2023 | (1.533) |
| EUR | 920.845 | HUF | 366.000.000 | Societe Generale | 21/6/2023 | (59.033) |
| EUR | 1.709.549 | NOK | 19.700.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 56.176 |
| EUR | 512.728 | NOK | 5.900.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 17.555 |
| EUR | 816.174 | NOK | 9.500.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 18.862 |
| EUR | 152.344 | NZD | 270.000 | Bank of America Merrill Lynch | 18/7/2023 | 1.135 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|------------|--|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 995.641 | SEK | 11.200.000 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | 30.701 |
| EUR | 67.625 | SEK | 770.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | 1.295 |
| EUR | 963.319 | USD | 1.060.000 | AUSTRALIAAND NEW ZEALAND BANKING GROUP | 18/7/2023 | (26.756) |
| EUR | 1.092.146 | USD | 1.190.000 | HSBC | 18/7/2023 | (19.353) |
| EUR | 3.685.346 | USD | 4.080.000 | Standard Chartered Bank | 18/7/2023 | (125.508) |
| GBP | 390.000 | USD | 487.505 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (4.233) |
| HUF | 366.000.000 | EUR | 889.059 | UBS | 21/6/2023 | 90.819 |
| JPY | 147.000.000 | USD | 1.066.760 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (13.970) |
| NOK | 5.000.000 | EUR | 438.328 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (18.690) |
| NOK | 11.800.000 | EUR | 1.021.288 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (30.942) |
| NOK | 13.152.389 | EUR | 1.157.233 | JP Morgan | 21/6/2023 | (53.384) |
| NOK | 17.847.611 | EUR | 1.546.620 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (48.712) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|------------|---------|-------------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| NOK | 5.500.000 | EUR | 472.576 | Natwest Markets | 21/6/2023 | (10.974) |
| NOK | 10.500.000 | EUR | 915.396 | Societe Generale | 21/6/2023 | (34.156) |
| NOK | 24.800.000 | USD | 2.341.001 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (108.618) |
| NZD | 2.290.000 | USD | 1.420.323 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (44.100) |
| NZD | 1.690.000 | USD | 1.019.320 | Citibank | 21/6/2023 | (5.542) |
| NZD | 1.690.000 | USD | 1.021.640 | Morgan Stanley Standard | 21/6/2023 | (7.712) |
| NZD | 1.550.000 | USD | 973.969 | Chartered Bank | 21/6/2023 | (41.651) |
| SEK | 11.200.000 | EUR | 972.032 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (7.092) |
| USD | 1.044.073 | AUD | 1.600.000 | Citibank | 21/6/2023 | 6.258 |
| USD | 967.323 | AUD | 1.440.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 31.506 |
| USD | 925.982 | CNH | 6.420.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 22.416 |
| USD | 488.356 | GBP | 390.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 5.030 |
| USD | 1.054.765 | JPY | 147.000.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 2.748 |
| USD | 963.376 | NOK | 9.900.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 70.362 |
| USD | 1.424.642 | NOK | 14.900.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 82.242 |
| USD | 1.059.033 | NZD | 1.690.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 42.693 |
| USD | 1.059.332 | NZD | 1.690.000 | Citibank | 21/6/2023 | 42.972 |
| USD | 920.505 | NZD | 1.500.000 | HSBC | 21/6/2023 | 19.684 |
| USD | 1.465.520 | NZD | 2.340.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 58.334 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 79.262.419) | | | | | | (527.613) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 56,27 |
| Finanzen | 27,29 |
| Versorger | 3,84 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 3,16 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 2,90 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 1,48 |
| Kommunikation | 1,15 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 1,12 |
| Industrie | 0,39 |
| Zyklische Konsumgüter | 0,33 |
| Technologie | 0,31 |
| Energie | 0,20 |
| Grundstoffe | 0,15 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,59 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,41 |
| | 100,00 |

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|-----------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Finnland Fortsetzung | | | |
| | | | | EUR 352.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 16/6/2028 | 291.794 | 0,13 |
| | | | | EUR 1.250.000 | OP Corporate Bank Plc RegS FRN 9/6/2030 | 1.157.700 | 0,51 |
| | | | | | | 1.826.513 | 0,81 |
| ANLEIHEN | | | | Frankreich | | | |
| | Australien | | | EUR 289.000 | AXA SA RegS FRN 7/10/2041 | 219.984 | 0,10 |
| EUR 136.000 | Telstra Corp Ltd RegS 1,375% 26/3/2029 | 120.952 | 0,05 | EUR 700.000 | AXA SA RegS FRN 11/7/2043 | 701.358 | 0,31 |
| EUR 500.000 | Transurban Finance Co Pty Ltd RegS 4,225% 26/4/2033 | 506.085 | 0,23 | EUR 1.017.000 | AXA SA RegS FRN 28/5/2049 | 921.026 | 0,41 |
| | | 627.037 | 0,28 | EUR 100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 2,625% 18/3/2024 | 98.989 | 0,04 |
| | Österreich | | | EUR 400.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,01% 7/3/2025 | 373.832 | 0,17 |
| EUR 800.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 744.304 | 0,33 | EUR 300.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1,00% 23/5/2025 | 284.274 | 0,13 |
| EUR 800.000 | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 4,125% 18/1/2027^ | 796.800 | 0,35 | EUR 1.000.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1,25% 26/5/2027 | 907.300 | 0,40 |
| EUR 200.000 | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 2,00% 25/8/2032 | 179.614 | 0,08 | EUR 2.200.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 4,125% 13/3/2029 | 2.232.032 | 0,99 |
| EUR 300.000 | Raiffeisen Bank International AG RegS FRN 26/1/2027 | 296.214 | 0,13 | EUR 400.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,625% 21/2/2031 | 305.644 | 0,14 |
| | | 2.016.932 | 0,89 | EUR 2.500.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 5,125% 13/1/2033 | 2.492.875 | 1,10 |
| | Belgien | | | EUR 500.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025 | 479.760 | 0,21 |
| EUR 800.000 | Belfius Bank SA RegS FRN 6/4/2034 | 634.328 | 0,28 | EUR 300.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 4/6/2026 | 280.536 | 0,12 |
| EUR 100.000 | Elia Transmission Belgium SA RegS 1,375% 7/4/2027 | 92.485 | 0,04 | EUR 1.300.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 11/7/2030 | 1.057.862 | 0,47 |
| EUR 100.000 | KBC Group NV RegS 0,75% 18/10/2023 | 98.932 | 0,04 | EUR 1.400.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 1.258.250 | 0,56 |
| EUR 1.800.000 | KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026 | 1.645.290 | 0,73 | EUR 1.100.000 | Bouygues SA RegS 5,375% 30/6/2042 | 1.204.049 | 0,53 |
| EUR 500.000 | KBC Group NV RegS FRN 1/3/2027 | 449.955 | 0,20 | EUR 1.300.000 | BPCE SA RegS FRN 14/1/2028^ | 1.130.545 | 0,50 |
| EUR 1.200.000 | KBC Group NV RegS FRN 21/1/2028^ | 1.053.120 | 0,47 | EUR 200.000 | BPCE SA RegS 0,25% 14/1/2031 | 152.166 | 0,07 |
| EUR 200.000 | KBC Group NV RegS FRN 31/12/2099 | 171.586 | 0,07 | EUR 700.000 | BPCE SA RegS 4,00% 29/11/2032 | 699.699 | 0,31 |
| | | 4.145.696 | 1,83 | EUR 900.000 | BPCE SA RegS FRN 2/2/2034 | 736.830 | 0,33 |
| | Kanada | | | EUR 800.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 571.080 | 0,25 |
| EUR 2.400.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 14/1/2027 | 2.124.569 | 0,94 | EUR 800.000 | BPCE SFH SA RegS 3,00% 17/10/2029 | 791.952 | 0,35 |
| EUR 300.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 23/7/2024 | 287.610 | 0,13 | EUR 300.000 | BPCE SFH SA RegS 3,125% 20/1/2033 | 296.964 | 0,13 |
| EUR 1.129.000 | Toronto-Dominion Bank RegS 3,631% 13/12/2029 | 1.088.615 | 0,48 | EUR 1.600.000 | Credit Agricole SA RegS 0,75% 5/12/2023 | 1.576.448 | 0,70 |
| | | 3.500.794 | 1,55 | EUR 1.300.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 12/10/2026 | 1.297.413 | 0,57 |
| | Dänemark | | | EUR 400.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 5/6/2030 | 372.540 | 0,16 |
| EUR 100.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 2/9/2030 | 90.993 | 0,04 | EUR 800.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 5/10/2023^ | 792.744 | 0,35 |
| EUR 1.408.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 15/5/2031 | 1.242.208 | 0,55 | EUR 400.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 3,375% 19/9/2027 | 392.676 | 0,17 |
| DKK 0 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 | EUR 500.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 | 425.745 | 0,19 |
| EUR 250.000 | Orsted A/S RegS FRN 8/12/3022 | 249.108 | 0,11 | EUR 500.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS FRN 11/6/2029 | 432.515 | 0,19 |
| GBP 385.000 | Orsted AS RegS 4,875% 12/1/2032 | 423.462 | 0,19 | EUR 400.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,75% 18/1/2030 | 325.252 | 0,14 |
| | | 2.005.771 | 0,89 | | | | |
| | Finnland | | | | | | |
| EUR 435.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 | 377.019 | 0,17 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| EUR 1.100.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 3,125% 22/6/2027 [^] | 1.096.953 | 0,49 | EUR 2.825.000 | Bayer AG RegS 4,625% 26/5/2033 | 2.888.930 | 1,28 |
| EUR 1.500.000 | Danone SA RegS 1/12/2025 (Zero Coupon) | 1.381.065 | 0,61 | EUR 600.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 470.616 | 0,21 |
| EUR 400.000 | Electricite de France SA RegS 1,00% 29/11/2033 | 289.356 | 0,13 | EUR 300.000 | Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023 | 297.294 | 0,13 |
| EUR 700.000 | Electricite de France SA RegS 4,625% 25/1/2043 | 666.624 | 0,30 | EUR 1.000.000 | Commerzbank AG RegS FRN 18/1/2030 | 999.290 | 0,44 |
| EUR 200.000 | Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual) | 152.504 | 0,07 | EUR 100.000 | Commerzbank AG RegS FRN 29/12/2031 | 83.793 | 0,04 |
| EUR 400.000 | Engie SA RegS 4,00% 11/1/2035 | 402.088 | 0,18 | EUR 1.100.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS FRN 31/12/2099 [^] | 877.602 | 0,39 |
| EUR 400.000 | Engie SA RegS 1,25% 24/10/2041 | 247.496 | 0,11 | EUR 300.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 23/2/2028 | 266.358 | 0,12 |
| EUR 750.000 | France Government Bond OAT RegS (traded in France) 3,00% 25/5/2054 | 697.267 | 0,31 | EUR 2.100.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/5/2028 [^] | 1.942.752 | 0,86 |
| EUR 2.300.000 | La Banque Postale SA RegS 4,375% 17/1/2030 | 2.270.422 | 1,00 | EUR 1.000.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 5/9/2030 | 967.420 | 0,43 |
| EUR 400.000 | Orange SA RegS 1,00% 12/5/2025 | 382.192 | 0,17 | EUR 500.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 19/5/2031 | 486.440 | 0,22 |
| EUR 500.000 | Orange SA RegS 1,00% 12/9/2025 | 474.765 | 0,21 | EUR 500.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 445.240 | 0,20 |
| EUR 100.000 | Orange SA RegS 1,875% 12/9/2030 | 90.034 | 0,04 | EUR 500.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 17/1/2025 | 459.060 | 0,20 |
| EUR 200.000 | Orange SA RegS 3,625% 16/11/2031 [^] | 201.794 | 0,09 | EUR 800.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 708.104 | 0,31 |
| EUR 600.000 | Orange SA RegS 2,375% 18/5/2032 | 550.470 | 0,24 | EUR 500.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023 | 495.775 | 0,22 |
| EUR 800.000 | Orange SA RegS FRN 31/12/2099 | 762.064 | 0,34 | EUR 400.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,875% 10/6/2025 | 386.860 | 0,17 |
| EUR 400.000 | RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 1,625% 8/10/2024 | 388.800 | 0,17 | EUR 200.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,113% 15/5/2032 | 161.928 | 0,07 |
| EUR 800.000 | Societe Generale SA RegS FRN 13/1/2025 [^] | 800.688 | 0,35 | EUR 1.000.000 | Evonik Industries AG RegS 0,625% 18/9/2025 | 935.750 | 0,41 |
| EUR 800.000 | Societe Generale SA RegS 0,125% 18/2/2028 | 672.408 | 0,30 | EUR 265.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028 | 236.730 | 0,10 |
| EUR 900.000 | Societe Generale SA RegS FRN 12/6/2029 | 733.581 | 0,32 | EUR 800.000 | Hannover Rueck SE RegS FRN 26/8/2043 | 832.992 | 0,37 |
| EUR 3.600.000 | Societe Generale SA RegS FRN 6/12/2030 | 3.486.060 | 1,54 | EUR 1.256.000 | Heidelberg Materials AG RegS 3,75% 31/5/2032 | 1.214.878 | 0,54 |
| EUR 800.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,75% 29/1/2027 [^] | 731.864 | 0,32 | EUR 700.000 | Merck Financial Services GmbH RegS 0,005% 15/12/2023 | 687.484 | 0,30 |
| EUR 1.600.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,75% 18/10/2027 | 1.442.752 | 0,64 | EUR 900.000 | Robert Bosch GmbH RegS 4,375% 2/6/2043 | 927.441 | 0,41 |
| EUR 900.000 | Teleperformance RegS 3,75% 24/6/2029 [^] | 864.387 | 0,38 | EUR 300.000 | Vonovia SE RegS 5,00% 23/11/2030 | 288.582 | 0,13 |
| EUR 250.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 208.463 | 0,09 | EUR 500.000 | Vonovia SE RegS 2,375% 25/3/2032 [^] | 402.625 | 0,18 |
| EUR 1.100.000 | Valeo RegS 1,00% 3/8/2028 [^] | 892.980 | 0,40 | EUR 800.000 | Vonovia SE RegS 1,00% 16/6/2033 [^] | 533.272 | 0,24 |
| EUR 800.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 722.864 | 0,32 | | | 20.269.809 | 8,97 |
| EUR 800.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 660.064 | 0,29 | Irland | | | |
| EUR 600.000 | WPP Finance SA RegS 4,125% 30/5/2028 | 604.998 | 0,27 | EUR 145.000 | AIB Group Plc RegS 1,25% 28/5/2024 | 141.124 | 0,06 |
| | | 44.687.343 | 19,77 | EUR 861.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/7/2026 | 846.802 | 0,37 |
| Deutschland | | | | EUR 114.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/4/2028 | 103.911 | 0,05 |
| EUR 400.000 | Allianz SE RegS FRN 7/9/2038 | 392.900 | 0,17 | EUR 645.000 | AIB Group Plc RegS FRN 16/2/2029 | 669.059 | 0,30 |
| EUR 100.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2049 | 100.065 | 0,04 | EUR 350.000 | AIB Group Plc RegS FRN 23/7/2029 | 345.503 | 0,15 |
| EUR 500.000 | Allianz SE RegS FRN 8/7/2050 | 412.860 | 0,18 | EUR 109.000 | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co RegS FRN 17/9/2050 | 87.845 | 0,04 |
| EUR 800.000 | Allianz SE RegS FRN 5/7/2052 | 742.888 | 0,33 | GBP 454.000 | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co RegS FRN 23/11/2052 | 463.990 | 0,21 |
| EUR 600.000 | BASF SE RegS 4,25% 8/3/2032 | 623.880 | 0,28 | | | 2.658.234 | 1,18 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------|---|------------------------|--------------------|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Italien | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| EUR 356.000 | A2A SpA RegS 4,375% 3/2/2034 | 354.985 | 0,16 | EUR 100.000 | de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024 | 95.315 | 0,04 |
| EUR 601.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028 | 532.720 | 0,23 | EUR 800.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 751.640 | 0,33 |
| EUR 1.800.000 | ASTM SpA RegS 1,50% 25/1/2030* | 1.463.472 | 0,65 | EUR 300.000 | de Volksbank NV RegS 4,875% 7/3/2030 | 303.597 | 0,13 |
| EUR 500.000 | ASTM SpA RegS 2,375% 25/11/2033 | 390.140 | 0,17 | EUR 500.000 | de Volksbank NV RegS FRN 22/10/2030 | 456.370 | 0,20 |
| EUR 1.055.000 | Enel SpA RegS FRN 31/12/2099 | 917.048 | 0,41 | EUR 628.000 | Digital Dutch Finco BV RegS 0,625% 15/7/2025 | 574.494 | 0,25 |
| EUR 435.000 | Enel SpA RegS FRN 31/12/2099 | 437.962 | 0,19 | EUR 300.000 | Digital Dutch Finco BV RegS 1,25% 1/2/2031 | 225.735 | 0,10 |
| EUR 1.078.000 | Hera SpA RegS 0,25% 3/12/2030* | 818.892 | 0,36 | GBP 405.000 | E.ON International Finance BV 6,375% 7/6/2032 | 486.385 | 0,22 |
| EUR 1.250.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 5,25% 13/1/2030 | 1.286.738 | 0,57 | GBP 450.000 | E.ON International Finance BV RegS 5,875% 30/10/2037 | 507.644 | 0,23 |
| EUR 346.456 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,40% 15/5/2039 | 358.617 | 0,16 | EUR 325.000 | EDP Finance BV RegS 3,875% 11/3/2030* | 326.966 | 0,15 |
| EUR 447.000 | Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030 | 361.073 | 0,16 | EUR 339.000 | ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group RegS FRN 29/12/2049 | 321.298 | 0,14 |
| | | 6.921.647 | 3,06 | USD 705.000 | Enel Finance International NV RegS 7,50% 14/10/2032 | 733.266 | 0,32 |
| Japan | | | | EUR 700.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099* | 634.816 | 0,28 |
| EUR 1.963.000 | Nissan Motor Co Ltd RegS 3,201% 17/9/2028* | 1.775.475 | 0,79 | EUR 600.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 591.210 | 0,26 |
| USD 225.000 | Nissan Motor Co Ltd RegS 4,81% 17/9/2030 | 181.494 | 0,08 | EUR 400.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099* | 388.920 | 0,17 |
| EUR 1.200.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd RegS 0,01% 15/10/2027 | 1.029.612 | 0,45 | EUR 100.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 95.069 | 0,04 |
| | | 2.986.581 | 1,32 | EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2027 | 184.284 | 0,08 |
| Jersey | | | | EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 1/2/2030 | 238.977 | 0,11 |
| EUR 341.000 | Aptiv Plc 1,50% 10/3/2025 | 326.426 | 0,14 | EUR 1.600.000 | ING Groep NV RegS (traded in Germany) FRN 18/2/2029 | 1.321.792 | 0,59 |
| | | 326.426 | 0,14 | EUR 1.100.000 | ING Group NV RegS FRN 23/5/2034 | 1.110.582 | 0,49 |
| Luxemburg | | | | EUR 100.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 87.670 | 0,04 |
| EUR 733.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1,213% 12/2/2036 | 525.671 | 0,23 | EUR 980.000 | Nederlandse Waterschapsbank NV RegS 3,00% 20/4/2033 | 977.991 | 0,43 |
| EUR 360.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1,336% 13/8/2041 | 228.561 | 0,10 | EUR 580.000 | NN Group NV RegS FRN 1/3/2043* | 554.631 | 0,25 |
| EUR 470.000 | GELF Bond Issuer I SA RegS 1,125% 18/7/2029 | 370.454 | 0,16 | EUR 300.000 | Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 2,75% 9/9/2030 | 291.159 | 0,13 |
| EUR 750.000 | Highland Holdings Sarl 0,934% 15/12/2031* | 589.800 | 0,26 | EUR 625.000 | Sika Capital BV RegS 3,75% 3/5/2030 | 630.238 | 0,28 |
| EUR 1.035.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1,75% 2/7/2049 | 657.204 | 0,29 | EUR 100.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 98.932 | 0,04 |
| EUR 328.000 | Nestle Finance International Ltd RegS 3/3/2033 (Zero Coupon) | 242.510 | 0,11 | EUR 300.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 277.950 | 0,12 |
| EUR 354.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,875% 23/3/2030 | 295.293 | 0,13 | EUR 300.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 306.324 | 0,14 |
| EUR 1.217.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 1.003.903 | 0,45 | EUR 1.426.000 | TenneT Holding BV RegS 4,50% 28/10/2034 | 1.532.052 | 0,68 |
| | | 3.913.396 | 1,73 | EUR 1.041.000 | TenneT Holding BV RegS FRN 31/12/2099 | 1.026.020 | 0,45 |
| Niederlande | | | | EUR 1.500.000 | Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 3,625% 24/4/2025 | 1.495.890 | 0,66 |
| EUR 700.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,375% 20/10/2028 | 699.965 | 0,31 | EUR 803.000 | Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 27/10/2025 (Zero Coupon) | 736.656 | 0,33 |
| EUR 1.000.000 | ABN AMRO Bank NV RegS FRN 22/2/2033 | 988.440 | 0,44 | EUR 802.000 | Universal Music Group NV RegS (traded in International) 3,75% 30/6/2032 | 788.430 | 0,35 |
| EUR 500.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,50% 21/11/2034 | 505.130 | 0,22 | | | | |
| EUR 300.000 | Adecco International Financial Services BV RegS 0,50% 21/9/2031 | 227.805 | 0,10 | | | | |
| EUR 275.000 | Coca-Cola HBC Finance BV RegS 2,75% 23/9/2025 | 271.037 | 0,12 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Niederlande Fortsetzung | | | | Supranationale Anleihen | | |
| EUR 300.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,625% 7/10/2039 | 172.464 | 0,08 | EUR 1.130.000 | European Investment Bank RegS 0,05% 27/1/2051 [^] | 469.221 | 0,21 |
| EUR 400.000 | Vonovia Finance BV RegS 1,00% 28/1/2041 | 201.484 | 0,09 | | | 469.221 | 0,21 |
| EUR 626.000 | Wolters Kluwer NV RegS 3,00% 23/9/2026 | 615.759 | 0,27 | | Schweden | | |
| EUR 625.000 | Wolters Kluwer NV RegS 3,75% 3/4/2031 | 628.631 | 0,28 | EUR 299.000 | Lansforsakringar Bank AB RegS 0,125% 19/2/2025 | 280.136 | 0,12 |
| | | 22.463.018 | 9,94 | EUR 608.000 | Skandinaviska Enskilda B anken AB RegS 0,05% 1/7/2024 | 584.446 | 0,26 |
| | Neuseeland | | | EUR 1.100.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 3,75% 7/2/2028 | 1.079.441 | 0,48 |
| EUR 600.000 | Chorus Ltd 3,625% 7/9/2029 | 587.808 | 0,26 | EUR 812.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028 | 797.960 | 0,35 |
| EUR 1.314.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 | 1.300.400 | 0,57 | EUR 405.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 1,375% 23/2/2029 | 348.191 | 0,16 |
| EUR 799.000 | Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026 [^] | 716.056 | 0,32 | EUR 1.643.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,50% 18/2/2030 | 1.297.477 | 0,58 |
| | | 2.604.264 | 1,15 | EUR 180.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 162.117 | 0,07 |
| | Norwegen | | | EUR 1.173.000 | Swedbank AB RegS FRN 20/5/2027 | 1.039.665 | 0,46 |
| EUR 1.796.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 31/5/2026 | 1.716.958 | 0,76 | EUR 777.000 | Swedbank AB RegS FRN 18/9/2028 | 766.270 | 0,34 |
| EUR 1.060.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 21/9/2027 | 1.038.641 | 0,46 | EUR 700.000 | Telia Co AB RegS 3,625% 22/2/2032 | 701.652 | 0,31 |
| EUR 800.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,01% 12/5/2028 | 684.384 | 0,30 | EUR 814.000 | Volvo Treasury AB RegS 2,125% 1/9/2024 [^] | 797.175 | 0,35 |
| EUR 121.000 | Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon) | 119.573 | 0,05 | | | 7.854.530 | 3,48 |
| | | 3.559.556 | 1,57 | | Schweiz | | |
| | Portugal | | | EUR 300.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 24/6/2027 | 265.248 | 0,12 |
| EUR 300.000 | EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 14/3/2082 | 255.618 | 0,11 | EUR 2.093.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 1.788.154 | 0,79 |
| | | 255.618 | 0,11 | EUR 3.763.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 1/3/2029 | 4.170.533 | 1,85 |
| | Singapur | | | EUR 1.964.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 1.696.896 | 0,75 |
| USD 890.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,30% 19/5/2053 | 849.912 | 0,38 | EUR 800.000 | Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 4,84% 3/11/2028 | 812.104 | 0,36 |
| | | 849.912 | 0,38 | EUR 200.000 | UBS Group AG RegS 1,50% 30/11/2024 | 190.972 | 0,08 |
| | Südkorea | | | EUR 241.000 | UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026 | 221.971 | 0,10 |
| USD 200.000 | Woori Bank RegS 4,875% 26/1/2028 | 187.926 | 0,08 | EUR 727.000 | UBS Group AG RegS 0,25% 24/2/2028 | 597.405 | 0,26 |
| | | 187.926 | 0,08 | | | 9.743.283 | 4,31 |
| | Spanien | | | | Großbritannien | | |
| EUR 600.000 | Banco de Sabadell SA RegS 3,50% 28/8/2026 | 601.698 | 0,27 | EUR 504.000 | Anglo American Capital Plc RegS 5,00% 15/3/2031 [^] | 519.100 | 0,23 |
| EUR 100.000 | Banco Santander SA RegS 3,375% 11/1/2026 | 99.739 | 0,04 | EUR 1.689.000 | Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025 | 1.626.490 | 0,72 |
| EUR 500.000 | Banco Santander SA RegS 3,25% 14/2/2028 | 498.330 | 0,22 | EUR 341.000 | Barclays Plc RegS FRN 24/1/2026 | 324.005 | 0,14 |
| EUR 400.000 | Banco Santander SA RegS 0,125% 4/6/2030 | 319.960 | 0,14 | EUR 2.175.000 | Barclays Plc RegS FRN 29/1/2034 | 2.204.210 | 0,98 |
| EUR 400.000 | Banco Santander SA RegS FRN 31/12/2099 | 265.500 | 0,12 | EUR 509.000 | British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024 | 489.974 | 0,22 |
| EUR 900.000 | CaixaBank SA RegS FRN 18/11/2026 | 814.986 | 0,36 | EUR 1.245.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030 | 1.004.254 | 0,44 |
| EUR 500.000 | CaixaBank SA RegS FRN 14/11/2030 | 516.555 | 0,23 | EUR 344.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 12/9/2029 | 307.519 | 0,14 |
| EUR 300.000 | Iberdrola Finanzas SA RegS 3,125% 22/11/2028 | 298.572 | 0,13 | EUR 1.618.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 24/9/2029 | 1.342.180 | 0,59 |
| EUR 300.000 | Iberdrola Finanzas SA RegS FRN 31/12/2099 | 252.021 | 0,11 | | | | |
| EUR 400.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 1,00% 27/2/2024 | 391.784 | 0,17 | | | | |
| EUR 300.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024 | 289.038 | 0,13 | | | | |
| | | 4.348.183 | 1,92 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| EUR 2.127.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 10/3/2032 [^] | 2.153.587 | 0,95 | EUR 304.000 | Coca-Cola Co 1,875% 22/9/2026 [^] | 290.314 | 0,13 |
| EUR 368.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 16/11/2032 | 379.886 | 0,17 | EUR 395.000 | Digital Euro Finco LLC RegS 1,125% 9/4/2028 | 328.447 | 0,15 |
| EUR 892.000 | Investec Bank Plc RegS FRN 17/2/2027 | 762.053 | 0,34 | EUR 817.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 435.240 | 0,19 |
| EUR 476.000 | National Grid Electricity Transmission Plc RegS 0,823% 7/7/2032 | 366.915 | 0,16 | EUR 300.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025 | 276.039 | 0,12 |
| EUR 1.025.000 | National Grid Plc RegS 0,553% 18/9/2029 | 834.647 | 0,37 | EUR 300.000 | Fidelity National Information Services Inc 1,50% 21/5/2027 | 273.120 | 0,12 |
| EUR 196.000 | National Grid Plc RegS 2,949% 30/3/2030 | 183.576 | 0,08 | EUR 586.000 | Fidelity National Information Services Inc 1,00% 3/12/2028 | 503.458 | 0,22 |
| EUR 625.000 | National Grid Plc RegS 4,275% 16/1/2035 | 621.350 | 0,28 | EUR 904.000 | General Motors Financial Co Inc RegS 0,65% 7/9/2028 [^] | 749.127 | 0,33 |
| EUR 1.725.000 | Nationwide Building Society RegS 3,625% 15/3/2028 | 1.751.341 | 0,77 | EUR 1.030.000 | Global Payments Inc 4,875% 17/3/2031 | 1.043.407 | 0,46 |
| EUR 275.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 [^] | 226.402 | 0,10 | EUR 1.000.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024 | 1.000.740 | 0,44 |
| EUR 908.000 | Nationwide Building Society RegS FRN 25/7/2029 | 869.410 | 0,38 | EUR 1.712.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 1,375% 15/5/2024 | 1.671.511 | 0,74 |
| EUR 450.000 | Nationwide Building Society RegS 3,25% 5/9/2029 | 430.218 | 0,19 | EUR 2.415.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 1.999.958 | 0,88 |
| EUR 644.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 15/11/2025 | 612.135 | 0,27 | EUR 903.000 | International Business Machines Corp 0,30% 11/2/2028 | 781.759 | 0,35 |
| EUR 447.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 2/3/2026 | 426.854 | 0,19 | EUR 150.000 | International Business Machines Corp 1,25% 9/2/2034 | 115.617 | 0,05 |
| EUR 505.000 | NatWest Markets Plc RegS 0,125% 12/11/2025 | 460.545 | 0,20 | EUR 1.800.000 | International Business Machines Corp 3,75% 6/2/2035 | 1.764.301 | 0,78 |
| EUR 444.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082 | 380.126 | 0,17 | EUR 2.606.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 23/3/2030 | 2.325.243 | 1,03 |
| EUR 1.594.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 25/8/2028 | 1.513.678 | 0,67 | EUR 1.300.000 | Kraft Heinz Foods Co FRN 9/5/2025 [^] | 1.301.663 | 0,58 |
| EUR 1.858.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 1.497.288 | 0,66 | EUR 1.675.000 | Morgan Stanley FRN 26/7/2024 | 1.667.730 | 0,74 |
| EUR 377.000 | SSE Plc RegS 1,75% 16/4/2030 | 333.095 | 0,15 | EUR 886.000 | Morgan Stanley FRN 8/5/2026 | 851.309 | 0,38 |
| EUR 811.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 744.676 | 0,33 | EUR 700.000 | Morgan Stanley FRN 2/3/2029 | 712.342 | 0,32 |
| USD 495.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025 | 444.742 | 0,20 | EUR 300.000 | Morgan Stanley FRN 26/10/2029 | 245.727 | 0,11 |
| EUR 1.805.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,375% 18/1/2031 | 1.810.848 | 0,80 | EUR 1.837.000 | Morgan Stanley FRN 25/1/2034 | 1.927.913 | 0,85 |
| GBP 1.975.000 | United Kingdom Gilt RegS 3,75% 22/10/2053 | 2.000.714 | 0,89 | EUR 319.000 | National Grid North America Inc RegS 1,054% 20/1/2031 | 255.837 | 0,11 |
| | | 26.621.818 | 11,78 | EUR 891.000 | Prologis Euro Finance LLC 0,50% 16/2/2032 | 650.608 | 0,29 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | EUR 894.000 | RELX Capital Inc 1,30% 12/5/2025 [^] | 853.856 | 0,38 |
| EUR 165.000 | AbbVie Inc 1,25% 18/11/2031 | 136.564 | 0,06 | EUR 344.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 1,875% 1/10/2049 | 222.884 | 0,10 |
| EUR 1.202.000 | American Tower Corp 0,95% 5/10/2030 | 946.166 | 0,42 | EUR 500.000 | Toyota Motor Credit Corp RegS 4,05% 13/9/2029 | 510.558 | 0,23 |
| EUR 525.000 | American Tower Corp 4,625% 16/5/2031 | 526.698 | 0,23 | EUR 302.000 | Verizon Communications Inc 0,875% 2/4/2025 | 287.833 | 0,13 |
| EUR 303.000 | American Tower Corp 1,00% 15/1/2032 | 227.038 | 0,10 | EUR 600.000 | Verizon Communications Inc 0,375% 22/3/2029 | 500.646 | 0,22 |
| EUR 625.000 | AT&T Inc 4,30% 18/11/2034 | 637.619 | 0,28 | EUR 416.000 | Verizon Communications Inc 1,875% 26/10/2029 | 373.464 | 0,17 |
| USD 1.200.000 | Bank of America Corp FRN 25/4/2034 | 1.115.895 | 0,49 | GBP 790.000 | Verizon Communications Inc 1,875% 19/9/2030 | 714.984 | 0,32 |
| EUR 455.000 | Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032 | 359.341 | 0,16 | EUR 301.000 | Verizon Communications Inc 2,625% 1/12/2031 | 277.272 | 0,12 |
| EUR 1.788.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 1.593.757 | 0,70 | EUR 1.015.000 | Verizon Communications Inc 4,75% 31/10/2034 | 1.086.107 | 0,48 |
| EUR 895.000 | Baxter International Inc 1,30% 15/5/2029 | 770.805 | 0,34 | | | | |
| EUR 450.000 | Booking Holdings Inc 4,25% 15/5/2029 | 464.397 | 0,21 | | | | |
| EUR 1.880.000 | Citigroup Inc RegS FRN 6/7/2026 | 1.769.569 | 0,78 | | | | |
| EUR 535.000 | Citigroup Inc RegS FRN 24/7/2026 | 505.029 | 0,22 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| EUR 405.000 | Verizon Communications Inc 1,125% 19/9/2035 | 291.328 | 0,13 |
| | | 35.343.220 | 15,64 |
| Gesamt Anleihen | | 210.186.728 | 92,99 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 210.186.728 | 92,99 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 131.007 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)^ | 13.038.518 | 5,77 |
| | | 13.038.518 | 5,77 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 13.038.518 | 5,77 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 223.225.246 | 98,76 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 2.793.490 | 1,24 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 226.018.736 | 100,00 |
| ^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier. - Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | EUR 8.776.593 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (117.801) | (29.812) |
| CCCDs | EUR 11.000.000 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (25.066) | (92.945) |
| CCCDs | EUR 21.528.239 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Subordinated Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (695.954) | 690.482 |
| CCILS | EUR 580.000 | Fund receives Fixed 2,458% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2033 | (1.340) | (1.969) |
| CCILS | EUR 354.141 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2032 | (4.885) | (4.118) |
| CCILS | EUR 164.970 | Fund receives Fixed 2,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2032 | (3.333) | (3.213) |
| CCILS | EUR 648.000 | Fund receives Fixed 2,574% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (733) | (716) |
| CCILS | EUR 600.000 | Fund receives Fixed 2,601% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2043 | (5.411) | (4.979) |
| CCILS | EUR 595.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,435% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 2.018 | 2.223 |
| CCILS | EUR 580.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,485% | Bank of America Merrill Lynch | 15/2/2028 | (866) | (369) |
| CCILS | EUR 413.164 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,700% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2027 | 1.773 | 939 |
| CCILS | EUR 114.970 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,720% | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2027 | 1.530 | 1.523 |
| CCIRS | EUR 1.872.336 | Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2032 | (265.249) | (304.567) |
| CCIRS | EUR 3.765.024 | Fund receives Fixed 2,499% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 6/9/2032 | (130.673) | (131.478) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|---------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 674.202 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,797% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2052 | 215.720 | 241.597 |
| CCIRS | EUR 1.503.408 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,190% | Bank of America Merrill Lynch | 6/9/2052 | 132.881 | 123.603 |
| CDS | EUR 419.000 | Fund receives default protection on Heidelberg Materials AG and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (1.429) | (69.997) |
| CDS | EUR 279.000 | Fund receives default protection on Holcim AG and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (1.533) | 1.468 |
| CDS | EUR 537.803 | Fund receives default protection on Holcim AG and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (2.576) | 2.830 |
| CDS | EUR 161.081 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 2.783 | 989 |
| CDS | EUR 74.643 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 814 | 459 |
| CDS | EUR 397.803 | Fund receives default protection on Heidelberg Materials AG and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (906) | (66.456) |
| CDS | EUR 816.803 | Fund receives default protection on Next Group Plc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (4.238) | 13.526 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 54.606.100) | | | | | (904.474) | 369.020 |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILs: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 CDS: Credit Default Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| 79 | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 9.317.260 | 40.610 |
| (5) | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 578.200 | (10.105) |
| (39) | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 5.292.690 | (44.847) |
| 11 | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.514.700 | 38.981 |
| 117 | EUR | Euro Schatz Futures June 2023 | Juni 2023 | 12.351.105 | 28.539 |
| 16 | GBP | Three Month SONIA Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 4.438.701 | 4.026 |
| 3 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 335.529 | 4.518 |
| (22) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 2.478.606 | (12.912) |
| (17) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 1.821.749 | (14.375) |
| (8) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 817.198 | (3.359) |
| (3) | USD | US Ultra Bond Futures September 2023 | September 2023 | 382.814 | (6.252) |
| Gesamt | | | | | 24.824 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|--|----------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 11.000.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2023; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 0,85 | 21/06/2023 | 8.548 | 25.554 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 6.105.000) | | | | | | 8.548 | 25.554 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|--------------|---|----------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (1.850.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed annually from 25/8/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 25/8/2024 | Citibank | GBP 4,75 | 25/08/2023 | (9.937) | (17.949) |
| (11.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2023; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 0,98 | 21/06/2023 | 10.118 | (3.962) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 2.990.648) | | | | | | 181 | (21.911) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-------------|---------|-------------|---|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISETERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 540.000 | USD | 358.431 | Citibank | 21/6/2023 | (7.778) |
| AUD | 510.000 | USD | 341.870 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (10.482) |
| | | | | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | (8.636) |
| CNH | 2.330.000 | USD | 336.600 | Societe Generale | 21/6/2023 | (61.149) |
| EUR | 6.183.346 | CHF | 6.078.600 | BNP Paribas | 18/7/2023 | (296) |
| EUR | 11.277 | GBP | 10.000 | HSBC | 18/7/2023 | (84) |
| EUR | 11.490 | GBP | 10.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | (24.034) |
| EUR | 1.017.579 | GBP | 900.000 | Natwest Markets | 18/7/2023 | (9.743) |
| EUR | 418.475 | GBP | 370.000 | Standard Chartered Bank | 18/7/2023 | (39.406) |
| EUR | 1.766.056 | GBP | 1.560.000 | Toronto Dominion Bank | 18/7/2023 | (15.279) |
| EUR | 1.848.050 | GBP | 1.610.000 | Societe Generale | 21/6/2023 | (20.968) |
| EUR | 327.076 | HUF | 130.000.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 26.725 |
| EUR | 933.143 | NOK | 10.800.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 6.176 |
| EUR | 140.460 | NOK | 1.600.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 10.388 |
| EUR | 337.779 | SEK | 3.800.000 | AUSTRALIAAND NEW ZEALAND BANKING GROUP | 18/7/2023 | (27.766) |
| EUR | 999.670 | USD | 1.100.000 | Citibank | 18/7/2023 | (11.126) |
| EUR | 726.760 | USD | 790.000 | HSBC | 18/7/2023 | (2.276) |
| EUR | 231.232 | USD | 250.000 | Standard Chartered Bank | 18/7/2023 | (104.590) |
| EUR | 3.071.121 | USD | 3.400.000 | Standard Chartered Bank | 18/7/2023 | 3.728 |
| GBP | 470.000 | EUR | 540.225 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (1.520) |
| GBP | 140.000 | USD | 175.002 | UBS | 21/6/2023 | 32.258 |
| HUF | 130.000.000 | EUR | 315.786 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (4.752) |
| JPY | 50.000.000 | USD | 362.844 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (7.199) |
| NOK | 1.800.000 | EUR | 158.269 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (14.806) |
| NOK | 5.500.000 | EUR | 476.407 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (13.134) |
| NOK | 6.000.000 | EUR | 516.699 | JP Morgan | 21/6/2023 | (18.743) |
| NOK | 4.618.336 | EUR | 406.350 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (2.815) |
| NOK | 681.664 | EUR | 60.025 | Societe Generale | 21/6/2023 | (11.711) |
| NOK | 3.600.000 | EUR | 313.850 | | | |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISETERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| NOK | 7.000.000 | USD | 661.069 | Bank of America | 21/6/2023 | (30.941) |
| NOK | 1.800.000 | USD | 169.725 | Merrill Lynch | 21/6/2023 | (7.709) |
| | | | | Deutsche Bank | 21/6/2023 | |
| | | | | Bank of America | 21/6/2023 | |
| NZD | 810.000 | USD | 502.376 | Merrill Lynch | 21/6/2023 | (15.590) |
| NZD | 580.000 | USD | 349.826 | Citibank | 21/6/2023 | (1.902) |
| NZD | 550.000 | USD | 345.777 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (14.943) |
| NZD | 580.000 | USD | 350.622 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (2.647) |
| SEK | 3.800.000 | EUR | 329.815 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (2.425) |
| USD | 352.375 | AUD | 540.000 | Citibank | 21/6/2023 | 2.112 |
| USD | 342.724 | AUD | 510.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 11.281 |
| USD | 336.065 | CNH | 2.330.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 8.135 |
| USD | 527.000 | EUR | 489.322 | Bank of America | 18/7/2023 | 2.914 |
| USD | 420.000 | EUR | 381.738 | Merrill Lynch | 18/7/2023 | 2.914 |
| USD | 828.000 | EUR | 751.467 | HSBC | 18/7/2023 | 10.555 |
| USD | 175.307 | GBP | 140.000 | Natwest Markets | 18/7/2023 | 21.912 |
| USD | 358.763 | JPY | 50.000.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 1.806 |
| USD | 340.588 | NOK | 3.500.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 935 |
| USD | 506.788 | NOK | 5.300.000 | Bank of America | 21/6/2023 | 24.875 |
| USD | 363.455 | NZD | 580.000 | Merrill Lynch | 21/6/2023 | 29.287 |
| USD | 363.558 | NZD | 580.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 14.652 |
| USD | 513.650 | NZD | 820.000 | Merrill Lynch | 21/6/2023 | 14.748 |
| USD | 331.382 | NZD | 540.000 | Citibank | 21/6/2023 | 20.528 |
| | | | | Morgan Stanley | 21/6/2023 | |
| | | | | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | 7.086 |
| | | | | | | (244.349) |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 45.652 | SEK | 517.325 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 1.080 |
| SEK | 30.265.798 | EUR | 2.698.650 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (91.024) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 40.300.881) | | | | | | (89.944) |
| | | | | | | (334.293) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023 Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|-----------------|
| Finanzen | 58,72 |
| Versorger | 9,69 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 7,18 |
| Kommunikation | 6,50 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 5,77 |
| Zyklische Konsumgüter | 4,07 |
| Industrie | 2,23 |
| Technologie | 2,02 |
| Staatsanleihen | 1,57 |
| Grundstoffe | 0,92 |
| Energie | 0,09 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,76 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,24 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|-------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| ANLEIHEN | | | | | | | |
| Andorra | | | | Kanada | | | |
| EUR 800.000 | Andorra International Bond RegS 1,25% 23/2/2027 | 727.240 | 0,56 | EUR 355.000 | Bank of Montreal RegS 1,00% 5/4/2026 | 331.204 | 0,26 |
| | | 727.240 | 0,56 | EUR 665.000 | Bank of Montreal RegS 3,375% 4/7/2026 | 662.535 | 0,51 |
| Australien | | | | EUR 600.000 | Bank of Nova Scotia RegS 0,01% 15/12/2027 | 517.116 | 0,40 |
| EUR 550.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd RegS 3,437% 4/4/2025 | 548.658 | 0,42 | EUR 900.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,375% 10/3/2026 | 825.948 | 0,64 |
| EUR 600.000 | Commonwealth Bank of Australia RegS 0,75% 28/2/2028 | 532.008 | 0,41 | EUR 325.000 | National Bank of Canada RegS 3,50% 25/4/2028 | 327.175 | 0,25 |
| EUR 1.300.000 | National Australia Bank Ltd RegS 0,625% 16/3/2027 | 1.170.832 | 0,91 | EUR 450.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 23/7/2024 | 431.415 | 0,34 |
| EUR 150.000 | Toyota Finance Australia Ltd RegS 0,064% 13/1/2025 | 141.383 | 0,11 | EUR 500.000 | Royal Bank of Canada RegS 0,125% 26/4/2027 | 441.728 | 0,34 |
| | | 2.392.881 | 1,85 | EUR 570.000 | Toronto-Dominion Bank RegS 0,864% 24/3/2027 | 519.105 | 0,40 |
| Österreich | | | | | | 4.056.226 | 3,14 |
| EUR 700.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 651.266 | 0,51 | Zypern | | | |
| EUR 200.000 | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 4,125% 18/1/2027 | 199.200 | 0,16 | EUR 160.000 | Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023 | 160.347 | 0,12 |
| EUR 100.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 95.142 | 0,07 | EUR 1.376.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,625% 3/12/2024 | 1.324.496 | 1,03 |
| EUR 200.000 | Raiffeisen Bank International AG RegS 1,50% 24/5/2027 | 185.762 | 0,14 | EUR 180.000 | Cyprus Government International Bond RegS 9/2/2026 (Zero Coupon) | 165.019 | 0,13 |
| EUR 1.100.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 1,75% 20/10/2023 | 1.094.489 | 0,85 | | | 1.649.862 | 1,28 |
| EUR 1.750.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 15/7/2024 (Zero Coupon) | 1.692.740 | 1,31 | Dänemark | | | |
| EUR 259.000 | Republic of Austria Government Bond RegS 2,90% 23/5/2029 | 261.802 | 0,20 | EUR 275.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 17/2/2027 | 252.516 | 0,20 |
| EUR 500.000 | UniCredit Bank Austria AG RegS 3,125% 21/9/2029 | 498.040 | 0,39 | DKK 0 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 |
| | | 4.678.441 | 3,63 | | | 252.516 | 0,20 |
| Belgien | | | | Finnland | | | |
| EUR 700.000 | Belfius Bank SA RegS 0,01% 15/10/2025 | 642.124 | 0,50 | EUR 230.000 | CRH Finland Services Oyj RegS 0,875% 5/11/2023 | 227.399 | 0,18 |
| EUR 200.000 | Elia Transmission Belgium SA RegS 1,375% 14/1/2026* | 189.656 | 0,15 | EUR 870.000 | Finland Government Bond RegS 15/9/2023 (Zero Coupon) | 862.683 | 0,67 |
| EUR 100.000 | KBC Bank NV RegS 3/12/2025 (Zero Coupon) | 92.065 | 0,07 | EUR 500.000 | Finland Government Bond RegS 4,00% 4/7/2025 | 512.550 | 0,40 |
| EUR 1.000.000 | KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026 | 914.050 | 0,71 | EUR 1.000.000 | Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj RegS 2,625% 1/12/2025 | 983.730 | 0,76 |
| EUR 200.000 | KBC Group NV RegS FRN 25/4/2033 | 196.940 | 0,15 | EUR 250.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 | 216.678 | 0,17 |
| EUR 280.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,20% 22/10/2023 | 276.800 | 0,21 | EUR 1.200.000 | OP Mortgage Bank RegS 1,00% 5/10/2027 | 1.097.076 | 0,85 |
| EUR 1.300.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 2,60% 22/6/2024* | 1.293.253 | 1,00 | EUR 520.000 | OP Mortgage Bank RegS 3,125% 20/10/2028 | 519.412 | 0,40 |
| EUR 800.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,50% 22/10/2024* | 773.984 | 0,60 | | | 4.419.528 | 3,43 |
| EUR 1.150.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2025 | 1.105.023 | 0,86 | Frankreich | | | |
| | | 5.483.895 | 4,25 | EUR 700.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 3,375% 25/5/2033 | 708.169 | 0,55 |
| | | | | EUR 500.000 | Arkea Home Loans SFH SA RegS 3,00% 30/3/2027 | 495.450 | 0,38 |
| | | | | EUR 300.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 4/6/2026 | 280.536 | 0,22 |
| | | | | EUR 400.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 30/5/2028 | 346.688 | 0,27 |
| | | | | EUR 400.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 359.500 | 0,28 |
| | | | | EUR 800.000 | BPCE SA RegS 0,25% 15/1/2026 | 730.456 | 0,57 |
| | | | | EUR 600.000 | BPCE SFH SA RegS 3,25% 12/4/2028 | 600.378 | 0,47 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|---|------------------------|--------------------|---------------|--|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland | | |
| EUR 2.000.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale RegS 2,875% 25/5/2027 | 1.992.600 | 1,54 | EUR 750.000 | Bayer AG RegS 4,25% 26/8/2029 | 766.657 | 0,59 |
| EUR 400.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale RegS 3,00% 25/5/2028 | 401.564 | 0,31 | EUR 300.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA RegS 3,50% 29/5/2029 | 295.020 | 0,23 |
| EUR 800.000 | Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026 | 742.480 | 0,58 | EUR 400.000 | Commerzbank AG RegS FRN 18/1/2030 | 399.716 | 0,31 |
| EUR 600.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024 | 586.278 | 0,45 | EUR 100.000 | Commerzbank AG RegS FRN 29/12/2031 | 83.793 | 0,06 |
| EUR 300.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 12/10/2026 | 299.403 | 0,23 | EUR 300.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 11/1/2029 | 298.251 | 0,23 |
| EUR 400.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 5/6/2030 | 372.540 | 0,29 | EUR 200.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 5/9/2030 | 193.484 | 0,15 |
| EUR 700.000 | Credit Mutuel Home Loan SFH SA RegS 0,25% 30/4/2024 | 678.755 | 0,53 | EUR 500.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 17/1/2025 | 459.060 | 0,36 |
| EUR 600.000 | FCT Autonoria '2023-DE A' RegS FRN 26/1/2043 | 600.870 | 0,47 | EUR 800.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,625% 9/7/2024 | 781.256 | 0,60 |
| EUR 200.000 | FCT Autonoria '2023-DE B' RegS FRN 26/1/2043 | 199.299 | 0,15 | EUR 2.600.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,50% 28/9/2026^ | 2.407.860 | 1,87 |
| EUR 66.415 | FCT Noria '2021-1 C' RegS FRN 25/10/2049 | 65.348 | 0,05 | EUR 900.000 | Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 0,125% 27/6/2023 | 898.173 | 0,70 |
| EUR 332.072 | FCT Noria '2021-1 D' RegS FRN 25/10/2049 | 322.344 | 0,25 | EUR 100.000 | Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale RegS 4,00% 4/2/2030 | 99.119 | 0,08 |
| EUR 1.900.000 | France Government Bond OAT RegS 25/3/2024 (Zero Coupon) | 1.851.873 | 1,43 | EUR 87.011 | Red & Black Auto Germany UG '8 B' RegS FRN 15/9/2030 | 86.364 | 0,07 |
| EUR 2.150.000 | France Government Bond OAT RegS 2,25% 25/5/2024^ | 2.132.219 | 1,65 | EUR 300.000 | Robert Bosch GmbH RegS 4,375% 2/6/2043 | 309.147 | 0,24 |
| EUR 6.740.000 | France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/11/2024 | 6.625.218 | 5,13 | EUR 100.000 | Vonovia SE RegS 1,375% 28/1/2026 | 91.350 | 0,07 |
| EUR 1.325.000 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2025 (Zero Coupon) | 1.261.029 | 0,98 | EUR 500.000 | Vonovia SE RegS 0,375% 16/6/2027 | 415.315 | 0,32 |
| EUR 2.200.000 | France Government Bond OAT RegS 1,00% 25/11/2025^ | 2.110.196 | 1,64 | | | 7.584.565 | 5,88 |
| EUR 3.550.000 | France Government Bond OAT RegS 25/2/2026 (Zero Coupon) | 3.300.186 | 2,56 | | Irland | | |
| EUR 1.055.000 | France Government Bond OAT RegS (traded in Germany) 3,00% 25/5/2054 | 980.823 | 0,76 | GBP 299.888 | Agora Securities UK '2021-1X A' DAC RegS FRN 22/7/2031 | 336.377 | 0,26 |
| EUR 200.000 | Ginkgo Auto Loans '2022-AL1 A' RegS FRN 25/7/2043 | 200.977 | 0,16 | EUR 375.000 | AIB Group Plc RegS FRN 4/7/2026 | 368.816 | 0,29 |
| EUR 426.848 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 A' RegS FRN 27/5/2061 | 429.191 | 0,33 | EUR 518.850 | Haus European Loan Conduit '39X A1' DAC RegS FRN 28/7/2051 | 487.719 | 0,38 |
| EUR 500.000 | La Banque Postale Home Loan SFH SA RegS 3,125% 19/2/2029 | 498.210 | 0,39 | EUR 750.000 | Ireland Government Bond RegS 3,40% 18/3/2024 | 752.347 | 0,58 |
| EUR 1.300.000 | La Banque Postale SA RegS FRN 9/2/2028 | 1.142.115 | 0,88 | EUR 282.774 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC '1X A' RegS FRN 17/8/2033 | 270.402 | 0,21 |
| EUR 600.000 | Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon) | 599.418 | 0,46 | EUR 499.897 | Last Mile Securities PE '2021-1X A1' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 483.993 | 0,37 |
| EUR 300.000 | Societe Generale SA RegS FRN 6/12/2030 | 290.505 | 0,22 | EUR 100.000 | Lt Autorahoitus '4 B' DAC RegS FRN 18/7/2033 | 100.234 | 0,08 |
| EUR 400.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026 | 358.036 | 0,28 | EUR 499.886 | Vita Scientia '2022-1X A' DAC RegS FRN 27/2/2033 | 483.640 | 0,37 |
| EUR 500.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,125% 18/7/2029 | 416.890 | 0,32 | EUR 500.000 | Vita Scientia '2022-1X B' DAC RegS FRN 27/2/2033 | 451.334 | 0,35 |
| EUR 130.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 123.668 | 0,10 | | | 3.734.862 | 2,89 |
| EUR 340.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 283.509 | 0,22 | | Italien | | |
| EUR 230.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 222.028 | 0,17 | EUR 124.544 | Autoflorence '2 B' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 122.387 | 0,09 |
| EUR 400.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 361.432 | 0,28 | EUR 100.000 | Brignole Co '2021 B' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 98.949 | 0,08 |
| | | 32.970.181 | 25,55 | EUR 250.000 | Enel SpA RegS FRN 31/12/2099 | 253.087 | 0,20 |
| | | | | EUR 500.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024 | 488.010 | 0,38 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------------------|---|------------------------|--------------------|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Italien Fortsetzung | | | | Niederlande Fortsetzung | | | |
| EUR 440.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,00% 4/7/2024 | 426.118 | 0,33 | EUR 100.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 98.535 | 0,08 |
| EUR 1.950.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,50% 15/1/2026 | 1.955.772 | 1,51 | EUR 300.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 291.690 | 0,23 |
| EUR 800.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,80% 15/4/2026 | 808.136 | 0,63 | EUR 500.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 475.345 | 0,37 |
| EUR 404.701 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,40% 15/5/2039 | 418.906 | 0,32 | EUR 100.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2027 | 92.142 | 0,07 |
| EUR 255.193 | Koromo Italy '1 A' Srl RegS FRN 26/2/2035 | 255.622 | 0,20 | EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 29/9/2028 | 168.902 | 0,13 |
| | | 4.826.987 | 3,74 | EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 15/2/2029 | 293.346 | 0,23 |
| Japan | | | | EUR 100.000 | ING Groep NV RegS (traded in Germany) FRN 18/2/2029 | 82.612 | 0,06 |
| EUR 475.000 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd RegS 3,629% 6/4/2026 | 474.012 | 0,37 | EUR 108.000 | Jubilee Place '3 B' RegS FRN 17/1/2059 | 104.884 | 0,08 |
| | | 474.012 | 0,37 | EUR 3.300.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2024 (Zero Coupon) | 3.240.171 | 2,51 |
| Jersey | | | | EUR 350.000 | Netherlands Government Bond RegS 0,25% 15/7/2025 | 332.500 | 0,26 |
| EUR 660.000 | Aptiv Plc 1,50% 10/3/2025 | 631.792 | 0,49 | EUR 600.000 | Netherlands Government Bond RegS 15/1/2026 (Zero Coupon) | 560.142 | 0,43 |
| | | 631.792 | 0,49 | EUR 230.000 | RELX Finance BV RegS 18/3/2024 (Zero Coupon) | 223.257 | 0,17 |
| Luxemburg | | | | EUR 100.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 98.932 | 0,08 |
| EUR 300.000 | Bumper De SA '2023-DE1 A' RegS FRN 23/8/2032 | 300.444 | 0,23 | EUR 570.000 | TenneT Holding BV RegS FRN 31/12/2099 | 532.944 | 0,41 |
| EUR 1.265.000 | European Financial Stability Facility RegS 3,00% 15/12/2028 | 1.270.123 | 0,98 | EUR 331.000 | Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 3,625% 24/4/2025 | 330.093 | 0,26 |
| EUR 673.000 | Nestle Finance International Ltd RegS 14/6/2026 (Zero Coupon) | 613.628 | 0,48 | EUR 100.000 | Wolters Kluwer NV RegS 3,75% 3/4/2031 | 100.581 | 0,08 |
| EUR 225.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,25% 23/3/2026 | 205.034 | 0,16 | | | 11.804.906 | 9,15 |
| | | 2.389.229 | 1,85 | Neuseeland | | | |
| Montenegro | | | | EUR 230.000 | Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026 | 206.124 | 0,16 |
| EUR 351.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027 | 288.414 | 0,22 | | | 206.124 | 0,16 |
| | | 288.414 | 0,22 | Norwegen | | | |
| Niederlande | | | | EUR 660.000 | DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023 | 649.301 | 0,50 |
| EUR 400.000 | ABN AMRO Bank NV RegS FRN 22/2/2033 | 395.376 | 0,31 | EUR 275.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 21/9/2027 | 269.459 | 0,21 |
| EUR 497.000 | BMW Finance NV RegS 0,625% 6/10/2023 | 491.990 | 0,38 | EUR 750.000 | DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 19/6/2025 | 708.533 | 0,55 |
| EUR 175.000 | Coca-Cola HBC Finance BV RegS 2,75% 23/9/2025 | 172.478 | 0,13 | EUR 225.000 | Eika Boligkreditt AS RegS 2,50% 22/9/2028 | 217.514 | 0,17 |
| EUR 500.000 | de Volksbank NV RegS 0,75% 25/6/2023 | 499.155 | 0,39 | EUR 731.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025 | 695.481 | 0,54 |
| EUR 500.000 | de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024 | 476.575 | 0,37 | EUR 125.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 3,00% 19/5/2030 | 123.580 | 0,09 |
| EUR 400.000 | de Volksbank NV RegS FRN 22/10/2030 | 365.096 | 0,28 | | | 2.663.868 | 2,06 |
| EUR 257.186 | Domi '2021-1 A' BV RegS FRN 15/6/2053 | 255.343 | 0,20 | Portugal | | | |
| EUR 154.000 | Domi '2023-1 A' BV RegS FRN 15/2/2055 | 154.601 | 0,12 | EUR 500.000 | Banco Santander Totta SA RegS 3,375% 19/4/2028 | 498.630 | 0,39 |
| EUR 100.000 | Domi '2023-1 B' BV RegS FRN 15/2/2055 | 98.757 | 0,08 | EUR 78.770 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Viriato Finance '1 B' RegS FRN 28/10/2040 | 75.439 | 0,06 |
| EUR 300.892 | Dutch Property Finance '2021-2 A' BV RegS FRN 28/4/2059 | 299.498 | 0,23 | | | 574.069 | 0,45 |
| EUR 445.259 | Dutch Property Finance '2023-1 A' BV RegS FRN 28/4/2064 | 445.471 | 0,34 | Singapur | | | |
| EUR 950.000 | Enel Finance International NV RegS 28/5/2026 (Zero Coupon) | 852.426 | 0,66 | USD 205.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,30% 19/5/2053 | 195.766 | 0,15 |
| EUR 300.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 272.064 | 0,21 | | | 195.766 | 0,15 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|---|------------------------|--------------------|----------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Slowakei | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| EUR 287.040 | Slovakia Government Bond RegS 4,00% 23/2/2043 | 284.594 | 0,22 | EUR 400.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 345.600 | 0,27 |
| EUR 400.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024 | 388.592 | 0,30 | EUR 400.000 | UBS Group AG RegS 0,25% 24/2/2028 | 328.696 | 0,26 |
| EUR 500.000 | Vseobecna Uverova Banka AS RegS 3,50% 13/10/2026 | 496.992 | 0,39 | | | 2.256.149 | 1,75 |
| | | 1.170.178 | 0,91 | Großbritannien | | | |
| Spanien | | | | EUR 450.000 | Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025 | 433.345 | 0,34 |
| EUR 140.639 | Autonoria Spain '2021-SP B' FT RegS FRN 31/1/2039 | 139.031 | 0,11 | GBP 100.000 | Barley Hill '2 B' Plc RegS FRN 27/8/2058 | 113.710 | 0,09 |
| EUR 600.000 | Banco Santander SA 0,01% 27/2/2025 | 563.790 | 0,44 | GBP 113.000 | Canada Square Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 128.197 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Banco Santander SA RegS 3,375% 11/1/2026 | 99.739 | 0,08 | GBP 200.000 | Dowson '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 231.465 | 0,18 |
| EUR 2.015.000 | Instituto de Credito Oficial RegS 0,75% 31/10/2023 | 1.992.009 | 1,54 | GBP 500.000 | Dowson '2022-1 D' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 568.692 | 0,44 |
| EUR 1.000.000 | Instituto de Credito Oficial RegS 1,30% 31/10/2026* | 942.350 | 0,73 | GBP 317.000 | Economic Master Issuer '2021- 1X A' Plc RegS FRN 25/6/2073 | 366.027 | 0,28 |
| EUR 429.000 | Instituto de Credito Oficial RegS 3,05% 31/10/2027 | 428.421 | 0,33 | GBP 150.100 | Economic Master Issuer '2023- 1 A' Plc RegS FRN 25/6/2074 | 174.537 | 0,14 |
| EUR 500.000 | Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024 | 481.730 | 0,37 | GBP 203.390 | Elvet Mortgages '2021-1 A' Plc RegS FRN 22/10/2063 | 235.089 | 0,18 |
| EUR 390.000 | Spain Government Bond 31/5/2025 (Zero Coupon) | 367.571 | 0,29 | GBP 440.374 | Finsbury Square '2021-1GRX AGRN' RegS FRN 16/12/2067 | 504.876 | 0,39 |
| EUR 3.150.000 | Spain Government Bond 31/1/2026 (Zero Coupon) | 2.915.136 | 2,26 | GBP 217.000 | Finsbury Square '2021-2X B' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 246.234 | 0,19 |
| EUR 1.936.000 | Spain Government Bond 2,80% 31/5/2026 | 1.923.726 | 1,49 | GBP 389.000 | Holmes Master Issuer '2023-1X A1' Plc RegS FRN 15/10/2072 | 452.785 | 0,35 |
| EUR 3.244.000 | Spain Government Bond RegS 4,40% 31/10/2023 | 3.257.657 | 2,52 | EUR 306.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 10/3/2032 | 309.825 | 0,24 |
| | | 13.111.160 | 10,16 | EUR 183.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 16/11/2032 | 188.911 | 0,15 |
| Supranationale Anleihen | | | | GBP 173.390 | London Wall Mortgage Capital '2021-FL1 A' Plc RegS FRN 15/5/2051 | 198.868 | 0,15 |
| EUR 767.000 | European Investment Bank RegS 2,75% 30/7/2030 | 761.163 | 0,59 | EUR 325.000 | National Grid Plc RegS 3,875% 16/1/2029 | 325.851 | 0,25 |
| EUR 166.518 | European Union RegS 3,375% 4/11/2042 | 166.779 | 0,13 | EUR 388.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 15/11/2025 | 368.802 | 0,29 |
| EUR 259.588 | European Union RegS 2,625% 4/2/2048 | 229.240 | 0,18 | EUR 503.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 2/3/2026 | 480.330 | 0,37 |
| | | 1.157.182 | 0,90 | EUR 400.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 6/9/2028 | 394.020 | 0,31 |
| Schweden | | | | EUR 275.000 | NatWest Markets Plc RegS 0,125% 12/11/2025 | 250.792 | 0,19 |
| EUR 540.000 | Skandinaviska Enskilda B anken AB RegS 0,05% 1/7/2024 | 519.080 | 0,40 | GBP 351.000 | Newday Funding Master Issuer Series '2022-1X A1' Plc R egS FRN 15/4/2030 | 406.384 | 0,31 |
| EUR 230.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,375% 3/7/2023 | 229.402 | 0,18 | EUR 100.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079 | 94.596 | 0,07 |
| EUR 450.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 0,125% 18/6/2024 | 433.494 | 0,34 | GBP 259.577 | Parkmore Point RMBS '2022- 1X A' Plc RegS FRN 25/7/2045 | 300.627 | 0,23 |
| EUR 100.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 90.065 | 0,07 | GBP 500.000 | Pierpont BTL '2021-1 B' Plc RegS FRN 22/12/2053 | 562.895 | 0,44 |
| EUR 559.000 | Swedbank AB RegS FRN 20/5/2027 | 495.458 | 0,38 | EUR 200.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 161.172 | 0,12 |
| EUR 400.000 | Swedbank AB RegS FRN 18/9/2028 | 394.476 | 0,31 | EUR 375.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 344.332 | 0,27 |
| EUR 450.000 | Volvo Treasury AB RegS 2,125% 1/9/2024 | 440.699 | 0,34 | USD 210.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025 | 188.678 | 0,15 |
| EUR 150.000 | Volvo Treasury AB RegS 1,625% 18/9/2025 | 143.456 | 0,11 | EUR 660.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,00% 18/4/2027 | 657.914 | 0,51 |
| | | 2.746.130 | 2,13 | | | | |
| Schweiz | | | | | | | |
| EUR 400.000 | Credit Suisse AG RegS 2,125% 31/5/2024 | 389.184 | 0,30 | | | | |
| EUR 500.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 16/1/2026 | 478.950 | 0,37 | | | | |
| EUR 186.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 13/10/2026 | 172.868 | 0,13 | | | | |
| EUR 488.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 1/3/2029 | 540.851 | 0,42 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| GBP 100.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 112.390 | 0,09 | EUR 1.300.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024 | 1.300.962 | 1,01 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 114.134 | 0,09 | EUR 460.000 | International Business Machines Corp 3,375% 6/2/2027 | 458.998 | 0,36 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X B' Plc RegS FRN 20/12/2063 | 113.853 | 0,09 | EUR 230.000 | National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023 | 228.790 | 0,18 |
| GBP 100.000 | Tower Bridge Funding '2023-1 D' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 116.471 | 0,09 | EUR 140.000 | Verizon Communications Inc 0,375% 22/3/2029 | 116.817 | 0,09 |
| GBP 227.000 | Tower Bridge Funding '2023-1X A' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 264.801 | 0,20 | | | 4.687.611 | 3,63 |
| GBP 137.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 153.439 | 0,12 | Gesamt Anleihen | | 126.983.531 | 98,41 |
| GBP 100.000 | Twin Bridges '2023-1 C' RegS FRN 14/6/2055 | 115.763 | 0,09 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 126.983.531 | 98,41 |
| GBP 159.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,00% 22/10/2063 | 169.952 | 0,13 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | | 9.849.757 | 7,63 | Irland | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | 10.910 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)* | 1.085.808 | 0,84 |
| EUR 175.000 | American Tower Corp 0,45% 15/1/2027 | 153.324 | 0,12 | | | 1.085.808 | 0,84 |
| EUR 900.000 | Bank of America Corp RegS FRN 22/9/2026 | 896.579 | 0,69 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 1.085.808 | 0,84 |
| EUR 155.000 | Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032 | 122.413 | 0,09 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 128.069.339 | 99,25 |
| EUR 250.000 | Becton Dickinson & Co 0,034% 13/8/2025 | 231.725 | 0,18 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 973.240 | 0,75 |
| USD 610.000 | Enel Finance America LLC RegS 7,10% 14/10/2027 | 609.363 | 0,47 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | 129.042.579 | 100,00 |
| EUR 618.000 | Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025 | 568.640 | 0,44 | | | | |

* Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

~ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|---|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | EUR 2.801.672 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (1.803) | (23.673) |
| CCILS | EUR 670.000 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | BNP Paribas | 15/12/2032 | (7.805) | (7.791) |
| CCILS | EUR 730.000 | Fund receives Fixed 2,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | BNP Paribas | 15/10/2032 | (14.231) | (14.216) |
| CCILS | EUR 768.000 | Fund receives Fixed 2,574% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | BNP Paribas | 15/5/2038 | (869) | (849) |
| CCILS | EUR 710.000 | Fund receives Fixed 2,601% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | BNP Paribas | 15/5/2043 | (6.403) | (5.892) |
| CCILS | EUR 700.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,435% | BNP Paribas | 15/5/2033 | 2.374 | 2.615 |
| CCILS | EUR 790.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,700% | BNP Paribas | 15/12/2027 | 1.787 | 1.796 |
| CCILS | EUR 650.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,720% | BNP Paribas | 15/10/2027 | 8.601 | 8.609 |
| CCIRS | EUR 810.000 | Fund receives Fixed 2,728% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | BNP Paribas | 3/4/2033 | 1.924 | 2.377 |
| CCIRS | EUR 810.000 | Fund receives Fixed 2,733% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | BNP Paribas | 18/4/2033 | 2.403 | 2.413 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|---------------|--|-------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 247.500 | Fund receives Fixed 2,760% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 6/5/2043 | 211 | 217 |
| CCIRS | EUR 830.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | BNP Paribas | 3/5/2033 | 3.737 | 3.592 |
| CCIRS | EUR 247.500 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | BNP Paribas | 9/5/2043 | 472 | 396 |
| CCIRS | EUR 670.000 | Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | BNP Paribas | 23/5/2033 | 6.008 | 5.731 |
| CCIRS | GBP 830.000 | Fund receives Fixed 4,190% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | BNP Paribas | 18/4/2026 | (16.540) | (16.462) |
| CCIRS | GBP 2.080.000 | Fund receives Fixed 4,287% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | BNP Paribas | 28/4/2026 | (35.006) | (34.994) |
| CCIRS | GBP 1.200.000 | Fund receives Fixed 4,505% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | BNP Paribas | 18/5/2025 | (13.049) | (14.042) |
| CCIRS | EUR 220.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,668% | BNP Paribas | 4/2/2048 | 1.953 | 1.960 |
| CCIRS | EUR 164.238 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,727% | BNP Paribas | 4/11/2042 | 2.960 | 3.460 |
| CCIRS | EUR 2.950.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,186% | BNP Paribas | 13/4/2028 | (21.917) | (21.889) |
| CCIRS | USD 2.560.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,639% | BNP Paribas | 2/5/2026 | 15.757 | 15.776 |
| CDS | EUR 270.000 | Fund receives default protection on Credit Suisse Group Finance Guernsey Ltd and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/12/2023 | (5.196) | 322 |
| CDS | EUR 230.000 | Fund receives default protection on Credit Suisse Group Finance Guernsey Ltd and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/12/2023 | (4.137) | 274 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 22.388.190) | | | | | (78.769) | (90.270) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps

CCILs: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps

CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps

CDS: Credit Default Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertrags- wahrung | Kontrakte/ Bezeichnung | Verfalls- datum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------------|---|--------------------|--|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (14) | USD | 3 Month SOFR Futures September 2023 | Dezember 2023 | 3.109.600 | 26.661 |
| (90) | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 10.614.600 | (7.576) |
| 124 | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 13.063.400 | 79.778 |
| (6) | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 693.840 | (12.120) |
| (22) | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 2.985.620 | (16.030) |
| (8) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.101.600 | 11.240 |
| 265 | EUR | Euro Schatz Futures June 2023 | Juni 2023 | 27.974.725 | 143.265 |
| (6) | EUR | Euro-OAT Futures June 2023 | Juni 2023 | 781.260 | (12.110) |
| (2) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 1.985.819 | (11.493) |
| 12 | GBP | Three Month SONIA Index Futures September 2023 | Dezember 2023 | 3.292.854 | (33.771) |
| 14 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 1.565.800 | 20.582 |
| (8) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 901.311 | (4.683) |
| 4 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 428.647 | 3.252 |
| (3) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 578.568 | (881) |
| (4) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 408.599 | (1.674) |
| Gesamt | | | | | 184.440 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|--------------|---|----------------|---------------|--------------------|---|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| | | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed annually from 25/8/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 25/8/2024 | | | | | |
| (2.700.000) | Put | | Morgan Stanley | GBP 4,75 | 25/08/2023 | (14.999) | (26.196) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 1.908.460) | | | | | | (14.999) | (26.196) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 320.000 | USD | 214.507 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (6.577) |
| AUD | 320.000 | USD | 212.232 | Royal Bank of Canada | 21/6/2023 | (4.449) |
| CAD | 40.000 | EUR | 27.351 | BNP Paribas | 18/7/2023 | 112 |
| CNH | 1.690.000 | USD | 244.151 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (6.271) |
| EUR | 182.627 | GBP | 160.000 | Bank of America Merrill Lynch | 18/7/2023 | (2.549) |
| EUR | 5.586.420 | GBP | 4.940.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | (130.878) |
| EUR | 367.465 | GBP | 320.000 | Royal Bank of Canada | 18/7/2023 | (2.885) |
| EUR | 208.846 | HUF | 83.000.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (13.367) |
| EUR | 598.625 | NOK | 6.900.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 19.525 |
| EUR | 93.973 | NOK | 1.100.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 1.653 |
| EUR | 28.212 | NZD | 50.000 | Bank of America Merrill Lynch | 18/7/2023 | 210 |
| EUR | 195.572 | SEK | 2.200.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 6.030 |
| EUR | 1.282.890 | USD | 1.420.000 | Royal Bank of Canada | 18/7/2023 | (43.437) |
| EUR | 183.927 | USD | 200.000 | UBS | 18/7/2023 | (2.879) |
| GBP | 130.000 | EUR | 149.585 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | 870 |
| GBP | 90.000 | USD | 112.501 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (977) |
| HUF | 83.000.000 | EUR | 201.049 | JP Morgan | 21/6/2023 | 21.164 |
| JPY | 30.000.000 | USD | 217.706 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (2.851) |
| NOK | 5.800.000 | EUR | 503.024 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (16.244) |
| NOK | 2.300.000 | EUR | 199.065 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (6.031) |
| NOK | 4.052.049 | EUR | 354.266 | JP Morgan | 21/6/2023 | (14.188) |
| NOK | 1.547.951 | EUR | 136.152 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (6.236) |
| NOK | 6.000.000 | USD | 566.235 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (26.150) |
| NZD | 700.000 | USD | 436.533 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (15.700) |
| NZD | 890.000 | USD | 541.394 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (7.214) |
| SEK | 2.200.000 | EUR | 190.932 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (1.390) |
| USD | 423.725 | AUD | 640.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 8.206 |
| USD | 243.755 | CNH | 1.690.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 5.901 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|---|---------|---------|------------|-------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 60.000 | EUR | 54.947 | BNP Paribas | 18/7/2023 | 1.094 |
| USD | 525.000 | EUR | 474.499 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | 15.868 |
| USD | 112.691 | GBP | 90.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 1.155 |
| USD | 215.258 | JPY | 30.000.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 561 |
| USD | 366.794 | NOK | 3.800.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 24.213 |
| USD | 210.686 | NOK | 2.200.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 12.457 |
| USD | 425.981 | NZD | 680.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 17.048 |
| USD | 325.745 | NZD | 520.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 13.033 |
| USD | 239.331 | NZD | 390.000 | Westpac | 21/6/2023 | 5.117 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 20.584.573) | | | | | | (156.056) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|-----------------|
| Staatsanleihen | 41,79 |
| Finanzen | 35,84 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 6,63 |
| Versorger | 3,97 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 2,93 |
| Zyklische Konsumgüter | 1,93 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 1,70 |
| Industrie | 1,69 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 0,84 |
| Technologie | 0,80 |
| Kommunikation | 0,64 |
| Energie | 0,49 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 99,25 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 0,75 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|--------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | | | | |
| STAMMAKTIEN | | | | | | | |
| | Österreich | | | Dänemark | | | |
| 22.817 | BAWAG Group AG | 929.108 | 0,36 | EUR 900.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 9/6/2029 [^] | 750.339 | 0,29 |
| | | 929.108 | 0,36 | DKK 1 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 |
| | Frankreich | | | EUR 325.000 | Orsted A/S RegS FRN 8/12/3022 | 323.840 | 0,12 |
| 11.388 | BNP Paribas SA | 619.621 | 0,24 | DKK 0 | Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050 | — | 0,00 |
| | | 619.621 | 0,24 | | | 1.074.179 | 0,41 |
| | Deutschland | | | Finnland | | | |
| 33.515 | Deutsche Bank AG | 317.924 | 0,12 | EUR 527.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 16/6/2028 | 436.862 | 0,16 |
| | | 317.924 | 0,12 | EUR 420.000 | OP Corporate Bank Plc RegS FRN 9/6/2030 | 388.987 | 0,15 |
| | Irland | | | | | 825.849 | 0,31 |
| 124.740 | AIB Group Plc | 477.255 | 0,18 | Frankreich | | | |
| | | 477.255 | 0,18 | EUR 500.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 3,375% 25/5/2033 | 505.835 | 0,19 |
| | Italien | | | EUR 1.875.000 | AXA SA RegS FRN 11/7/2043 | 1.878.638 | 0,72 |
| 68.858 | Intesa Sanpaolo SpA | 149.456 | 0,06 | EUR 2.800.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 5,125% 13/1/2033 | 2.792.020 | 1,07 |
| 187.211 | Iren SpA | 349.523 | 0,13 | EUR 500.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 11/7/2030 | 406.870 | 0,16 |
| 35.088 | UniCredit SpA | 636.918 | 0,24 | EUR 500.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 449.375 | 0,17 |
| | | 1.135.897 | 0,43 | EUR 800.000 | Bouygues SA RegS 5,375% 30/6/2042 | 875.672 | 0,33 |
| | Spanien | | | EUR 300.000 | BPCE SA RegS 0,25% 14/1/2031 | 228.249 | 0,09 |
| 48.700 | Banco Santander SA | 149.387 | 0,06 | EUR 1.000.000 | BPCE SA RegS 4,00% 29/11/2032 | 999.570 | 0,38 |
| | | 149.387 | 0,06 | EUR 1.300.000 | BPCE SA RegS FRN 2/2/2034 | 1.064.310 | 0,41 |
| | Großbritannien | | | EUR 1.600.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 1.142.160 | 0,44 |
| 436 | Barclays Plc | 767 | 0,00 | EUR 600.000 | BPCE SFH SA RegS 3,125% 20/1/2033 | 593.928 | 0,23 |
| | | 767 | 0,00 | EUR 900.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 [^] | 766.341 | 0,29 |
| Gesamt Stammaktien | | 3.629.959 | 1,39 | EUR 1.800.000 | Electricite de France SA RegS 4,625% 25/1/2043 | 1.714.176 | 0,65 |
| | | | | EUR 400.000 | Electricite de France SA RegS 2,00% 9/12/2049 | 234.052 | 0,09 |
| | ANLEIHEN | | | GBP 300.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 313.432 | 0,12 |
| | Österreich | | | EUR 3.000.000 | Engie SA RegS 4,25% 11/1/2043 | 2.981.550 | 1,14 |
| EUR 2.300.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 2.139.874 | 0,82 | EUR 3.200.000 | La Banque Postale SA RegS 4,375% 17/1/2030 | 3.158.848 | 1,21 |
| EUR 1.500.000 | BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 4,125% 18/1/2027 [^] | 1.494.000 | 0,57 | EUR 1.600.000 | Societe Generale SA RegS FRN 6/12/2030 | 1.549.360 | 0,59 |
| EUR 500.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 475.710 | 0,18 | EUR 1.400.000 | Teleperformance RegS 3,75% 24/6/2029 [^] | 1.344.602 | 0,51 |
| EUR 1.300.000 | Raiffeisen Bank International AG RegS FRN 26/1/2027 | 1.283.594 | 0,49 | EUR 400.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 29/12/2049 | 379.312 | 0,14 |
| | | 5.393.178 | 2,06 | EUR 2.000.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 1.667.700 | 0,64 |
| | Belgien | | | EUR 800.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 722.864 | 0,28 |
| EUR 1.400.000 | Argenta Spaarbank NV RegS FRN 29/11/2027 | 1.395.982 | 0,53 | EUR 200.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 165.016 | 0,06 |
| EUR 500.000 | KBC Group NV RegS FRN 21/1/2028 | 438.800 | 0,17 | | | 25.933.880 | 9,91 |
| | | 1.834.782 | 0,70 | Deutschland | | | |
| | Kanada | | | EUR 2.000.000 | Allianz SE RegS FRN 7/9/2038 | 1.964.500 | 0,75 |
| EUR 200.000 | National Bank of Canada RegS 3,50% 25/4/2028 | 201.339 | 0,08 | EUR 2.000.000 | Allianz SE RegS FRN 8/7/2050 | 1.651.440 | 0,63 |
| EUR 2.000.000 | Toronto-Dominion Bank RegS 3,631% 13/12/2029 | 1.928.460 | 0,73 | EUR 400.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 | 272.980 | 0,10 |
| | | 2.129.799 | 0,81 | | | | |
| | Kaimaninseln | | | | | | |
| USD 405.000 | CK Hutchison International 23 Ltd RegS 4,75% 21/4/2028 | 381.042 | 0,15 | | | | |
| USD 480.000 | CK Hutchison International 23 Ltd RegS 4,875% 21/4/2033 [^] | 451.454 | 0,17 | | | | |
| | | 832.496 | 0,32 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Indonesien Fortsetzung | | | |
| EUR 1.000.000 | BASF SE RegS 4,25% 8/3/2032 | 1.039.800 | 0,40 | USD 510.000 | Pertamina Geothermal Energy PT RegS 5,15% 27/4/2028 [^] | 477.640 | 0,18 |
| EUR 1.500.000 | Bayer AG RegS 4,25% 26/8/2029 | 1.533.315 | 0,59 | | | 665.301 | 0,25 |
| EUR 6.600.000 | Bayer AG RegS 4,625% 26/5/2033 | 6.749.358 | 2,58 | Irland | | | |
| EUR 800.000 | Bayer AG RegS FRN 25/3/2082 | 738.736 | 0,28 | EUR 2.375.000 | AIB Group Plc RegS FRN 16/2/2029 | 2.463.588 | 0,94 |
| EUR 700.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 549.052 | 0,21 | EUR 1.075.000 | AIB Group Plc RegS FRN 23/7/2029 | 1.061.186 | 0,41 |
| EUR 500.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,70% 15/8/2032 [^] | 477.950 | 0,18 | EUR 1.500.000 | Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 5/6/2026 | 1.423.275 | 0,54 |
| EUR 5.480.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 2,30% 15/2/2033 | 5.496.385 | 2,10 | | | 4.948.049 | 1,89 |
| EUR 2.500.000 | Commerzbank AG RegS FRN 18/1/2030 | 2.498.225 | 0,95 | Italien | | | |
| EUR 300.000 | Commerzbank AG RegS FRN 29/12/2031 | 251.379 | 0,10 | EUR 550.000 | A2A SpA RegS 4,375% 3/2/2034 | 548.433 | 0,21 |
| EUR 1.000.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 5/9/2030 | 967.420 | 0,37 | EUR 1.660.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028 [^] | 1.471.407 | 0,56 |
| EUR 400.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 19/11/2030 | 317.908 | 0,12 | EUR 990.000 | ASTM SpA RegS 1,50% 25/1/2030 | 804.910 | 0,31 |
| GBP 600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 12/12/2030 | 655.371 | 0,25 | EUR 1.075.000 | ASTM SpA RegS 2,375% 25/11/2033 | 838.801 | 0,32 |
| EUR 600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 19/5/2031 | 583.728 | 0,22 | EUR 1.425.000 | Enel SpA RegS FRN 31/12/2099 | 1.434.704 | 0,55 |
| EUR 1.000.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 890.480 | 0,34 | EUR 3.138.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 2.672.352 | 1,02 |
| EUR 322.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028 | 287.649 | 0,11 | EUR 900.000 | Hera SpA RegS 0,25% 3/12/2030 | 683.676 | 0,26 |
| EUR 1.900.000 | Hamburg Commercial Bank AG RegS FRN 22/9/2026 | 1.585.702 | 0,61 | EUR 1.600.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 5,25% 13/1/2030 | 1.647.024 | 0,63 |
| EUR 600.000 | Hannover Rueck SE RegS FRN 26/8/2043 | 624.744 | 0,24 | EUR 803.376 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,40% 15/5/2039 | 831.574 | 0,32 |
| EUR 1.742.000 | Heidelberg Materials AG RegS 3,75% 31/5/2032 | 1.684.967 | 0,64 | | | 10.932.881 | 4,18 |
| EUR 2.000.000 | IKB Deutsche Industriebank AG RegS FRN 31/1/2028 | 1.651.400 | 0,63 | Japan | | | |
| EUR 2.000.000 | Robert Bosch GmbH RegS 4,375% 2/6/2043 | 2.060.980 | 0,79 | EUR 1.620.000 | Nissan Motor Co Ltd RegS 3,201% 17/9/2028 [^] | 1.465.241 | 0,56 |
| EUR 696.000 | RWE AG RegS 2,75% 24/5/2030 | 645.721 | 0,25 | | | 1.465.241 | 0,56 |
| EUR 200.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 3,40% 7/3/2073 | 206.616 | 0,08 | Luxemburg | | | |
| EUR 300.000 | Vonovia SE RegS 5,00% 23/11/2030 | 288.582 | 0,11 | EUR 2.795.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1,336% 13/8/2041 [^] | 1.774.517 | 0,68 |
| | | 35.674.388 | 13,63 | EUR 1.500.000 | European Financial Stability Facility RegS 3,00% 15/12/2028 | 1.506.075 | 0,58 |
| Hongkong | | | | EUR 600.000 | GELF Bond Issuer I SA RegS 1,625% 20/10/2026 | 536.730 | 0,21 |
| USD 400.000 | AIA Group Ltd RegS 4,95% 4/4/2033 | 378.051 | 0,14 | EUR 908.000 | Holcim Finance Luxembourg SA RegS 0,625% 19/1/2033 | 658.945 | 0,25 |
| | | 378.051 | 0,14 | EUR 4.000.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1,625% 15/10/2050 | 2.404.840 | 0,92 |
| Ungarn | | | | EUR 750.000 | Segro Capital Sarl RegS 1,875% 23/3/2030 | 625.620 | 0,24 |
| EUR 2.800.000 | Erste Bank Hungary Zrt RegS FRN 4/2/2026 [^] | 2.559.760 | 0,98 | EUR 850.000 | SELP Finance Sarl RegS 3,75% 10/8/2027 | 793.798 | 0,30 |
| | | 2.559.760 | 0,98 | EUR 2.417.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 1.993.783 | 0,76 |
| Indien | | | | EUR 2.000.000 | Swiss Re Finance Luxembourg SA RegS FRN 30/4/2050 | 1.683.580 | 0,64 |
| USD 300.000 | REC Ltd RegS 5,625% 11/4/2028 | 280.675 | 0,11 | | | 11.977.888 | 4,58 |
| | | 280.675 | 0,11 | Malaysia | | | |
| Indonesien | | | | USD 885.000 | Khazanah Capital Ltd RegS 4,876% 1/6/2033 | 837.317 | 0,32 |
| USD 200.000 | Bank Mandiri Persero Tbk PT RegS 5,50% 4/4/2026 | 187.661 | 0,07 | USD 895.000 | Khazanah Global Sukuk Bhd RegS 4,687% 1/6/2028 | 841.241 | 0,32 |
| | | | | | | 1.678.558 | 0,64 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------|---|------------------------|--------------------|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Montenegro | | | | Singapur | | | |
| EUR 601.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027 | 493.837 | 0,19 | USD 2.075.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,30% 19/5/2053 | 1.981.537 | 0,76 |
| | | 493.837 | 0,19 | | | 1.981.537 | 0,76 |
| Niederlande | | | | Slowakei | | | |
| GBP 500.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 5,25% 26/5/2026 | 572.240 | 0,22 | EUR 354.578 | Slovakia Government Bond RegS 4,00% 23/2/2043 | 351.556 | 0,13 |
| EUR 900.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,375% 20/10/2028 | 899.955 | 0,34 | | | 351.556 | 0,13 |
| EUR 1.900.000 | ABN AMRO Bank NV RegS FRN 22/2/2033 | 1.878.036 | 0,72 | Südkorea | | | |
| EUR 900.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,50% 21/11/2034 | 909.234 | 0,35 | USD 400.000 | Shinhan Bank Co Ltd RegS 4,50% 12/4/2028 | 371.424 | 0,14 |
| EUR 2.000.000 | BP Capital Markets BV RegS 1,467% 21/9/2041 | 1.281.620 | 0,49 | USD 215.000 | SK On Co Ltd RegS 5,375% 11/5/2026 | 202.167 | 0,08 |
| EUR 900.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 845.595 | 0,32 | USD 300.000 | Woori Bank RegS 4,875% 26/1/2028 | 281.890 | 0,11 |
| EUR 1.800.000 | Digital Dutch Finco BV RegS 0,625% 15/7/2025 | 1.646.640 | 0,63 | | | 855.481 | 0,33 |
| GBP 1.150.000 | E.ON International Finance BV RegS 5,875% 30/10/2037 | 1.297.312 | 0,50 | Spanien | | | |
| USD 1.515.000 | Enel Finance International NV RegS 7,50% 14/10/2032 | 1.575.742 | 0,60 | EUR 1.000.000 | Banco Santander SA RegS FRN 31/12/2099 | 663.750 | 0,26 |
| EUR 800.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099* | 777.840 | 0,30 | EUR 1.800.000 | CaixaBank SA RegS FRN 18/11/2026 | 1.629.972 | 0,62 |
| EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025 | 285.207 | 0,11 | EUR 2.100.000 | CaixaBank SA RegS FRN 14/11/2030 | 2.169.531 | 0,83 |
| EUR 200.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2027 | 184.284 | 0,07 | EUR 2.400.000 | CaixaBank SA RegS FRN 30/5/2034 | 2.411.400 | 0,92 |
| EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 15/2/2029 | 293.346 | 0,11 | | | 6.874.653 | 2,63 |
| EUR 300.000 | ING Groep NV RegS FRN 1/2/2030 | 238.977 | 0,09 | Supranationale Anleihen | | | |
| EUR 1.700.000 | ING Groep NV RegS (traded in International) FRN 18/2/2029 | 1.404.404 | 0,54 | EUR 759.000 | European Investment Bank RegS 2,75% 30/7/2030 | 753.224 | 0,29 |
| EUR 700.000 | ING Group NV RegS FRN 23/5/2034 | 706.734 | 0,27 | EUR 810.000 | European Stability Mechanism RegS 1,85% 1/12/2055 | 575.246 | 0,22 |
| EUR 300.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 263.010 | 0,10 | EUR 490.000 | European Union RegS 3,375% 4/11/2042 | 490.769 | 0,19 |
| EUR 3.578.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099* | 3.354.625 | 1,28 | EUR 697.013 | European Union RegS 3,00% 4/3/2053 | 646.096 | 0,24 |
| EUR 1.533.000 | Shell International Finance BV RegS 1,875% 7/4/2032 | 1.336.638 | 0,51 | | | 2.465.335 | 0,94 |
| EUR 500.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 494.660 | 0,19 | Schweden | | | |
| EUR 500.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 510.540 | 0,19 | EUR 2.100.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028 | 2.063.691 | 0,79 |
| EUR 3.380.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7,875% 15/9/2031^ | 3.461.424 | 1,32 | EUR 600.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS 1,375% 23/2/2029 | 515.838 | 0,20 |
| | | 24.218.063 | 9,25 | GBP 112.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 23/8/2032 | 117.946 | 0,04 |
| Neuseeland | | | | EUR 1.200.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 1.080.780 | 0,41 |
| EUR 800.000 | Chorus Ltd 3,625% 7/9/2029 | 783.744 | 0,30 | | | 3.778.255 | 1,44 |
| NZD 125.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040 | 86.626 | 0,03 | Schweiz | | | |
| | | 870.370 | 0,33 | EUR 200.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 170.870 | 0,07 |
| Portugal | | | | EUR 2.572.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 1/3/2029 | 2.850.548 | 1,09 |
| EUR 149.284 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta '7 SEN' RegS 0,70% 12/2/2024 | 147.029 | 0,06 | GBP 356.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 15/11/2029 | 325.615 | 0,12 |
| | | 147.029 | 0,06 | EUR 6.900.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 5.961.600 | 2,28 |
| | | | | EUR 400.000 | UBS Group AG RegS FRN 17/3/2032 | 399.556 | 0,15 |
| | | | | | | 9.708.189 | 3,71 |
| | | | | Großbritannien | | | |
| | | | | EUR 562.000 | Anglo American Capital Plc RegS 5,00% 15/3/2031^ | 578.838 | 0,22 |
| | | | | EUR 1.575.000 | Anglo American Capital Plc RegS 4,75% 21/9/2032 | 1.580.197 | 0,60 |
| | | | | GBP 324.000 | Barclays Plc RegS FRN 31/1/2031 | 369.816 | 0,14 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| EUR 4.300.000 | Barclays Plc RegS FRN 29/1/2034 | 4.357.749 | 1,66 | USD 150.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6,484% 23/10/2045 | 127.000 | 0,05 |
| EUR 1.000.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual) | 927.170 | 0,35 | USD 1.390.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,80% 1/3/2050 | 951.445 | 0,36 |
| EUR 712.000 | BP Capital Markets Plc RegS FRN 31/12/2099 | 618.351 | 0,24 | USD 110.000 | Citigroup Inc FRN 25/5/2034 | 104.541 | 0,04 |
| EUR 1.825.000 | Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031 | 1.457.737 | 0,56 | EUR 693.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 369.182 | 0,14 |
| EUR 250.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 228.980 | 0,09 | EUR 3.000.000 | General Motors Financial Co Inc RegS 0,65% 7/9/2028^ | 2.486.040 | 0,95 |
| GBP 100.000 | Dignity Finance Plc RegS (traded in International) 4,696% 31/12/2049 | 73.706 | 0,03 | EUR 2.250.000 | Global Payments Inc 4,875% 17/3/2031 | 2.279.288 | 0,87 |
| GBP 167.000 | Dignity Finance Plc RegS (traded in Ireland) 4,696% 31/12/2049 | 123.089 | 0,05 | EUR 2.000.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 1.656.280 | 0,63 |
| EUR 1.000.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 24/9/2029 | 829.530 | 0,32 | EUR 1.325.000 | International Business Machines Corp 3,75% 6/2/2035 | 1.298.721 | 0,50 |
| EUR 2.722.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 10/3/2032 | 2.756.025 | 1,05 | GBP 156.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2026 | 165.045 | 0,06 |
| EUR 1.011.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 16/11/2032 | 1.043.655 | 0,40 | EUR 800.000 | Morgan Stanley FRN 2/3/2029 | 814.105 | 0,31 |
| EUR 700.000 | Investec Bank Plc RegS FRN 17/2/2027 | 598.024 | 0,23 | EUR 375.000 | Morgan Stanley FRN 7/5/2032 | 341.003 | 0,13 |
| GBP 180.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN 15/12/2031 | 176.461 | 0,07 | EUR 3.200.000 | Morgan Stanley FRN 25/1/2034^ | 3.358.368 | 1,28 |
| EUR 297.000 | National Grid Plc RegS 2,949% 30/3/2030 | 278.173 | 0,11 | EUR 1.775.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0,993% 15/10/2026 | 1.289.236 | 0,49 |
| EUR 659.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028^ | 542.542 | 0,21 | GBP 234.000 | Time Warner Cable LLC 5,75% 2/6/2031 | 253.293 | 0,10 |
| GBP 736.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 14/8/2030 | 795.389 | 0,30 | USD 263.430 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,125% 15/1/2033 | 239.016 | 0,09 |
| GBP 139.000 | NatWest Markets Plc RegS 6,375% 8/11/2027 | 163.337 | 0,06 | EUR 3.000.000 | Verizon Communications Inc 1,85% 18/5/2040^ | 2.159.961 | 0,83 |
| EUR 751.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082 | 642.961 | 0,25 | | | 25.291.154 | 9,66 |
| EUR 1.377.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 25/8/2028 | 1.307.613 | 0,50 | Gesamt Anleihen | | 212.112.468 | 81,03 |
| EUR 3.523.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 2.839.045 | 1,08 | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| EUR 1.150.000 | SSE Plc RegS FRN 31/12/2099 | 1.055.953 | 0,40 | Irland | | | |
| EUR 2.400.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,375% 18/11/2031 | 2.407.776 | 0,92 | EUR 28.331 | iShares EUR Corp Bond 1-5yr UCITS ETF^- | 2.909.894 | 1,11 |
| GBP 138.000 | Travis Perkins Plc RegS 4,50% 7/9/2023 | 158.080 | 0,06 | GBP 47.500 | iShares GBP Corp Bond 0-5yr UCITS ETF^- | 5.302.386 | 2,03 |
| GBP 512.741 | United Kingdom Inflation- Linked Gilt RegS 0,125% 10/8/2028 | 581.857 | 0,22 | | | 8.212.280 | 3,14 |
| | | 26.492.054 | 10,12 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | 8.212.280 | 3,14 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| EUR 209.000 | Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032 | 164.483 | 0,06 | | | 223.954.707 | 85,56 |
| EUR 675.000 | Air Products and Chemicals Inc 4,00% 3/3/2035 | 685.307 | 0,26 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| EUR 530.000 | American Tower Corp 0,875% 21/5/2029 | 434.036 | 0,17 | Irland | | | |
| EUR 1.758.000 | American Tower Corp 0,95% 5/10/2030 | 1.383.827 | 0,53 | 52.307 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc)^- | 5.205.860 | 1,99 |
| EUR 1.050.000 | American Tower Corp 4,625% 16/5/2031 | 1.053.397 | 0,40 | | | 5.205.860 | 1,99 |
| EUR 1.177.000 | American Tower Corp 1,00% 15/1/2032 | 881.926 | 0,34 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 5.205.860 | 1,99 |
| EUR 700.000 | AT&T Inc 4,30% 18/11/2034 | 714.133 | 0,27 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 229.160.567 | 87,55 |
| USD 1.400.000 | Bank of America Corp FRN 25/4/2034 | 1.301.877 | 0,50 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| EUR 310.000 | Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032 | 244.826 | 0,09 | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | |
| EUR 600.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 534.818 | 0,21 | | | | |

^ Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

- Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|---|----------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | |
| Belgien | | | |
| (4.982) | KBC Group NV | Bank of America Merrill Lynch | 2.989 |
| | | | 2.989 |
| Frankreich | | | |
| (44.857) | Credit Agricole SA | Bank of America Merrill Lynch | 42.345 |
| (14.325) | Societe Generale SA | Bank of America Merrill Lynch | 19.823 |
| | | | 62.168 |
| Italien | | | |
| (33.452) | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Bank of America Merrill Lynch | (17.696) |
| | | | (17.696) |
| Norwegen | | | |
| (9.403) | DNB Bank ASA | Bank of America Merrill Lynch | (592) |
| | | | (592) |
| Schweden | | | |
| (15.602) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.546 |
| (84.948) | Svenska Handelsbanken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 9.403 |
| (25.671) | Volvo AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 13.271 |
| | | | 24.220 |
| Schweiz | | | |
| (36.461) | UBS Group AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 5.487 |
| | | | 5.487 |
| Großbritannien | | | |
| (610.680) | Lloyds Banking Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 13.977 |
| | | | 13.977 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – EUR 3.780.097) | | | 90.553 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | EUR 17.000.000 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (209.705) | (459.966) |
| CCCDs | EUR 88.890.153 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (436.324) | (301.940) |
| CCCDs | EUR 25.000.000 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (56.967) | (211.238) |
| CCCDs | EUR 23.240.000 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Subordinated Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (762.632) | 745.384 |
| CCILs | EUR 465.000 | Fund receives Fixed 2,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | (4.057) | (4.047) |
| CCILs | EUR 910.000 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2032 | (10.601) | (10.582) |
| CCILs | EUR 500.000 | Fund receives Fixed 2,520% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 3/1/2038 | (7.851) | (5.404) |
| CCILs | EUR 436.000 | Fund receives Fixed 2,528% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 2.404 | 2.212 |
| CCILs | EUR 744.000 | Fund receives Fixed 2,574% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (842) | (823) |
| CCILs | EUR 920.000 | Fund receives Fixed 2,601% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2043 | (8.296) | (7.635) |
| CCILs | EUR 2.267.000 | Fund receives Fixed 2,654% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2024 | (2.949) | (2.936) |
| CCILs | EUR 465.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,338% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2028 | 1.833 | 1.840 |
| CCILs | EUR 910.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,435% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 3.086 | 3.399 |
| CCILs | EUR 2.267.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,440% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2025 | 2.822 | 2.836 |
| CCILs | EUR 500.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,475% | Bank of America Merrill Lynch | 3/1/2028 | 856 | 614 |
| CCILs | EUR 436.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,528% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2028 | (2.034) | (2.256) |
| CCILs | EUR 930.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,700% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2027 | 2.103 | 2.114 |
| CCIRs | EUR 8.756.000 | Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2032 | (1.426.215) | (1.424.313) |
| CCIRs | EUR 21.000.000 | Fund receives Fixed 1,370% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 12/4/2028 | (1.533.501) | (1.533.267) |
| CCIRs | EUR 491.500 | Fund receives Fixed 1,439% and pays Floating EUR 3 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | (120.797) | (120.973) |
| CCIRs | EUR 427.500 | Fund receives Fixed 2,287% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2073 | 11.309 | 3.925 |
| CCIRs | EUR 143.000 | Fund receives Fixed 2,400% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2073 | 6.283 | 5.918 |
| CCIRs | EUR 320.878 | Fund receives Fixed 2,408% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2048 | (14.563) | (14.552) |
| CCIRs | EUR 1.200.000 | Fund receives Fixed 2,410% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 30/3/2053 | (17.776) | (38.765) |
| CCIRs | EUR 490.000 | Fund receives Fixed 2,486% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2053 | (9.476) | (8.679) |
| CCIRs | EUR 7.700.000 | Fund receives Fixed 2,499% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 6/9/2032 | (269.023) | (268.890) |
| CCIRs | EUR 237.000 | Fund receives Fixed 2,680% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 8/5/2033 | (914) | (1.498) |
| CCIRs | EUR 251.000 | Fund receives Fixed 2,690% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2033 | (998) | (1.304) |
| CCIRs | EUR 240.000 | Fund receives Fixed 2,701% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 20/3/2033 | (653) | (1.038) |
| CCIRs | EUR 1.000.000 | Fund receives Fixed 2,728% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/4/2033 | 2.375 | 2.934 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|---------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 1.120.000 | Fund receives Fixed 2,748% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2033 | 3.681 | 3.695 |
| CCIRS | EUR 1.200.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2033 | 5.403 | 5.194 |
| CCIRS | EUR 470.000 | Fund receives Fixed 2,839% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2033 | 3.394 | 3.400 |
| CCIRS | EUR 800.000 | Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2033 | 7.174 | 6.843 |
| CCIRS | EUR 142.512 | Fund receives Fixed 2,900% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/5/2043 | 926 | 1.016 |
| CCIRS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 2,989% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2043 | 6.087 | 6.095 |
| CCIRS | EUR 142.511 | Fund receives Fixed 3,000% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2043 | 2.869 | 3.101 |
| CCIRS | EUR 117.000 | Fund receives Fixed 3,000% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2043 | 2.622 | 2.572 |
| CCIRS | GBP 1.970.000 | Fund receives Fixed 4,255% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2026 | (34.925) | (34.908) |
| CCIRS | GBP 3.955.000 | Fund receives Fixed 4,505% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/5/2025 | (43.008) | (46.281) |
| CCIRS | GBP 2.025.000 | Fund receives Fixed 5,115% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2025 | 2.850 | 2.817 |
| CCIRS | GBP 2.025.000 | Fund receives Fixed 5,254% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2025 | 8.914 | 8.872 |
| CCIRS | EUR 1.086.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,010% | Bank of America Merrill Lynch | 20/3/2025 | 4.176 | 6.033 |
| CCIRS | EUR 1.072.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,060% | Bank of America Merrill Lynch | 8/5/2025 | 3.643 | 4.483 |
| CCIRS | EUR 1.129.250 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,140% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2025 | 3.994 | 3.804 |
| CCIRS | EUR 421.194 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533% | Bank of America Merrill Lynch | 4/12/2049 | 165.860 | 168.027 |
| CCIRS | EUR 3.123.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,797% | Bank of America Merrill Lynch | 23/2/2052 | 1.124.280 | 1.119.110 |
| CCIRS | EUR 491.500 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,400% | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | 117.804 | 118.016 |
| CCIRS | EUR 230.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,089% | Bank of America Merrill Lynch | 23/1/2053 | 23.298 | 23.306 |
| CCIRS | EUR 3.000.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,190% | Bank of America Merrill Lynch | 6/9/2052 | 246.539 | 246.647 |
| CCIRS | EUR 612.276 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,270% | Bank of America Merrill Lynch | 4/3/2053 | 39.510 | 39.532 |
| CCIRS | EUR 180.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,360% | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2073 | (5.354) | (5.346) |
| CCIRS | EUR 1.200.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,410% | Bank of America Merrill Lynch | 30/3/2053 | 20.144 | 42.196 |
| CCIRS | EUR 490.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,491% | Bank of America Merrill Lynch | 20/2/2053 | 11.261 | 9.780 |
| CCIRS | EUR 7.400.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,607% | Bank of America Merrill Lynch | 27/2/2053 | (27.064) | (26.800) |
| CCIRS | EUR 628.500 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,669% | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2053 | (18.364) | (10.187) |
| CCIRS | EUR 321.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,723% | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2048 | (4.655) | (1.097) |
| CCIRS | EUR 460.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,727% | Bank of America Merrill Lynch | 4/11/2042 | 8.289 | 9.691 |
| CCIRS | EUR 208.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,730% | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2053 | (6.166) | (6.052) |
| CCIRS | EUR 514.286 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,906% | Bank of America Merrill Lynch | 12/1/2033 | 1.158 | 1.166 |
| CCIRS | EUR 1.500.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,144% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2028 | (11.443) | (11.426) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 962.000 | Fund receives default protection on Heidelberg Materials AG and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (3.280) | (160.708) |
| CDS | EUR 2.200.000 | Fund receives default protection on Credit Suisse Group Finance Guernsey Ltd and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2023 | (76.643) | 2.624 |
| CDS | EUR 15.000.000 | Fund receives default protection on Danske Bank A/S and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | 156.955 | (125.583) |
| CDS | EUR 641.000 | Fund receives default protection on Holcim AG and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (3.522) | 3.372 |
| CDS | EUR 1.234.000 | Fund receives default protection on Holcim AG and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (5.910) | 6.492 |
| CDS | EUR 443.000 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 7.653 | 2.721 |
| CDS | EUR 204.937 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 2.235 | 1.259 |
| CDS | EUR 5.300.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Swiss Reinsurance Co Ltd | JP Morgan | 20/6/2028 | 23.686 | 93.687 |
| CDS | EUR 913.000 | Fund receives default protection on Heidelberg Materials AG and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (2.080) | (152.523) |
| CDS | EUR 1.875.000 | Fund receives default protection on Next Group Plc and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/6/2028 | (9.728) | 31.049 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 272.495.785) | | | | | (3.110.840) | (2.253.241) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILS: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRS: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 CDS: Credit Default Swaps

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (562) | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 66.282.280 | (441.161) |
| (68) | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 7.863.520 | (206.652) |
| (481) | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 65.276.510 | (964.342) |
| 49 | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 6.747.300 | 205.681 |
| (407) | EUR | Euro Schatz Futures June 2023 | Juni 2023 | 42.964.955 | 80.363 |
| (240) | EUR | EURO STOXX 50 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 10.195.200 | 166.458 |
| (6) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 5.957.458 | (43.812) |
| 40 | GBP | Three Month SONIA Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 11.096.753 | 10.429 |
| 24 | GBP | Three Month SONIA Index Futures September 2024 | Dezember 2024 | 6.621.184 | (52.895) |
| 26 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 2.907.914 | 39.161 |
| (28) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 3.154.590 | (16.433) |
| (2) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 214.323 | (1.691) |
| (7) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 715.048 | (2.940) |
| (23) | USD | US Ultra Bond Futures September 2023 | September 2023 | 2.934.910 | (47.934) |
| Gesamt | | | | | (1.275.768) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|---|--------------|--|----------------|---------------|--------------------|---|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 25.000.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2023; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 0,85 | 21/06/2023 | 19.428 | 58.078 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 13.875.000) | | | | | | 19.428 | 58.078 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|--------------|---|----------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (2.350.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed annually from 25/8/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 25/8/2024 | Citibank | GBP 4,75 | 25/08/2023 | (12.623) | (22.801) |
| (25.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2023; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 0,98 | 21/06/2023 | 22.996 | (9.004) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 5.486.067) | | | | | | 10.373 | (31.805) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 630.000 | USD | 418.170 | Citibank | 21/6/2023 | (9.075) |
| AUD | 640.000 | USD | 429.014 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (13.154) |
| CNH | 3.120.000 | USD | 450.726 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | (11.564) |
| EUR | 7.767.786 | CHF | 7.636.200 | Societe Generale | 21/6/2023 | (76.818) |
| EUR | 263.413 | GBP | 230.000 | BNP Paribas | 18/7/2023 | (2.777) |
| EUR | 160.928 | GBP | 140.000 | HSBC | 18/7/2023 | (1.101) |
| EUR | 11.136.764 | GBP | 9.850.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | (263.109) |
| EUR | 294.361 | GBP | 260.000 | Standard Chartered Bank | 18/7/2023 | (6.550) |
| EUR | 516.683 | GBP | 450.000 | State Street Bank & Trust Company | 18/7/2023 | (4.124) |
| EUR | 412.619 | HUF | 164.000.000 | Societe Generale | 21/6/2023 | (26.452) |
| EUR | 65.210 | JPY | 9.490.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | 1.518 |
| EUR | 18.363 | JPY | 2.700.000 | Royal Bank of Canada | 18/7/2023 | 241 |
| EUR | 1.174.527 | NOK | 13.600.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 33.113 |
| EUR | 184.354 | NOK | 2.100.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 8.106 |
| EUR | 88.966 | NOK | 1.020.000 | Goldman Sachs | 18/7/2023 | 3.385 |
| EUR | 158.002 | NZD | 280.000 | Bank of America Merrill Lynch | 18/7/2023 | 1.193 |
| EUR | 391.112 | SEK | 4.400.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 12.028 |
| EUR | 64.536 | SEK | 730.000 | Bank of America Merrill Lynch | 18/7/2023 | 1.651 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|-----------|---|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 129.102 | SEK | 1.470.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | 2.472 |
| EUR | 45.059 | USD | 50.000 | Australia and New Zealand Banking Bank of America | 18/7/2023 | (1.642) |
| EUR | 2.675.306 | USD | 2.910.000 | Merrill Lynch | 18/7/2023 | (42.729) |
| EUR | 1.628.310 | USD | 1.770.000 | Citibank | 18/7/2023 | (24.928) |
| EUR | 663.037 | USD | 730.000 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | (18.807) |
| EUR | 127.062 | USD | 140.000 | Natwest Markets | 18/7/2023 | (3.703) |
| EUR | 6.223.209 | USD | 6.890.000 | Standard Chartered Bank | 18/7/2023 | (212.276) |
| GBP | 270.000 | EUR | 310.676 | Morgan Stanley | 18/7/2023 | 1.808 |
| GBP | 618.000 | EUR | 710.339 | Chartered Bank | 18/7/2023 | 4.902 |
| GBP | 170.000 | USD | 212.502 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (1.845) |
| HUF | 164.000.000 | EUR | 398.376 | UBS | 21/6/2023 | 40.695 |
| JPY | 58.000.000 | USD | 420.899 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (5.512) |
| NOK | 2.200.000 | EUR | 193.440 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (8.799) |
| NOK | 6.500.000 | EUR | 563.326 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (17.797) |
| NOK | 7.000.000 | EUR | 602.732 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (15.238) |
| NOK | 5.843.051 | EUR | 514.103 | JP Morgan | 21/6/2023 | (23.709) |
| NOK | 856.949 | EUR | 75.460 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (3.539) |
| NOK | 4.500.000 | EUR | 392.312 | Societe Generale | 21/6/2023 | (14.638) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|-----------|---------|------------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| NOK | 8.800.000 | USD | 831.058 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (38.897) |
| NOK | 2.400.000 | USD | 226.300 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (10.279) |
| NZD | 1.030.000 | USD | 638.850 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (19.849) |
| NZD | 670.000 | USD | 404.109 | Citibank | 21/6/2023 | (2.197) |
| NZD | 690.000 | USD | 433.793 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (18.746) |
| NZD | 670.000 | USD | 405.029 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (3.057) |
| SEK | 4.400.000 | EUR | 381.891 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (2.808) |
| USD | 411.104 | AUD | 630.000 | Citibank | 21/6/2023 | 2.464 |
| USD | 430.085 | AUD | 640.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 14.156 |
| USD | 450.010 | CNH | 3.120.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 10.894 |
| USD | 925.000 | EUR | 840.733 | HSBC | 18/7/2023 | 23.247 |
| USD | 212.873 | GBP | 170.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 2.192 |
| USD | 416.166 | JPY | 58.000.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 1.084 |
| USD | 428.167 | NOK | 4.400.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 31.272 |
| USD | 650.164 | NOK | 6.800.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 37.525 |
| USD | 419.853 | NZD | 670.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 16.926 |
| USD | 419.972 | NZD | 670.000 | Citibank | 21/6/2023 | 17.036 |
| USD | 417.296 | NZD | 680.000 | HSBC | 21/6/2023 | 8.923 |
| USD | 651.357 | NZD | 1.040.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 25.940 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 57.768.770) | | | | | | (602.948) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 45,86 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 9,50 |
| Versorger | 7,22 |
| Staatsanleihen | 4,86 |
| Energie | 4,67 |
| Zyklische Konsumgüter | 3,32 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 3,14 |
| Kommunikation | 3,05 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 1,99 |
| Grundstoffe | 1,54 |
| Industrie | 1,33 |
| Technologie | 1,01 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 0,06 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 87,55 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 12,45 |
| | <hr/> |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| | | | | USD 8.398.000 | Rogers Communications Inc 4,55% 15/3/2052 | 6.235.153 | 0,22 |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 14.391.389 0,50 | | | |
| ANLEIHEN | | | | Kaimaninseln | | | |
| Österreich | | | | USD 275.000 | Agile Group Holdings Ltd RegS 5,50% 21/4/2025 | 72.918 | 0,00 |
| EUR 1.200.000 | ams-OSRAM AG RegS 5/3/2025 (Zero Coupon) | 891.804 | 0,03 | USD 405.000 | CK Hutchison International 23 Ltd RegS 4,75% 21/4/2028 | 381.041 | 0,02 |
| EUR 300.000 | ams-OSRAM AG RegS 2,125% 3/11/2027 | 200.037 | 0,01 | USD 640.000 | CK Hutchison International 23 Ltd RegS 4,875% 21/4/2033 | 601.939 | 0,02 |
| EUR 12.700.000 | BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029 | 11.815.826 | 0,41 | USD 227.000 | Country Garden Holdings Co Ltd RegS 4,20% 6/2/2026 | 75.933 | 0,01 |
| EUR 700.000 | Erste Group Bank AG RegS FRN 30/5/2030 | 703.248 | 0,03 | USD 398.000 | Fantasia Holdings Group 10,875% 9/1/2023 | 29.820 | 0,00 |
| EUR 1.600.000 | Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024 | 1.522.272 | 0,05 | USD 227.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 9,25% 28/7/2023 | 18.872 | 0,00 |
| EUR 7.600.000 | Raiffeisen Bank International AG RegS FRN 26/1/2027 | 7.504.088 | 0,26 | USD 200.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 6,95% 17/12/2023 | 15.801 | 0,00 |
| <hr/> | | | | USD 227.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 11,875% 1/1/2024 | 18.711 | 0,00 |
| | | | | USD 630.000 | Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 11,75% 17/4/2024 | 47.202 | 0,00 |
| | | | | USD 185.999 | Modern Land China Co Ltd RegS 9,00% 30/12/2025 | 10.611 | 0,00 |
| Belgien | | | | USD 185.999 | Modern Land China Co Ltd RegS 9,00% 30/12/2026 | 10.276 | 0,00 |
| EUR 5.100.000 | Argenta Spaarbank NV RegS FRN 29/11/2027 | 5.085.363 | 0,18 | USD 254.000 | Ronshine China Holdings Ltd RegS 7,35% 15/12/2023 | 13.084 | 0,00 |
| EUR 7.700.000 | Argenta Spaarbank NV RegS (traded in Belgium) FRN 8/2/2029 | 6.345.955 | 0,22 | USD 300.000 | Ronshine China Holdings Ltd RegS 6,75% 5/8/2024 | 15.453 | 0,00 |
| EUR 2.100.000 | Argenta Spaarbank NV RegS (traded in Luxembourg) FRN 8/2/2029 | 1.730.715 | 0,06 | USD 310.000 | Sinic Holdings Group Co Ltd RegS 10,50% 18/6/2023 | 4.355 | 0,00 |
| EUR 2.300.000 | KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026 | 2.102.315 | 0,07 | USD 284.000 | Sunac China Holdings Ltd RegS 7,95% 11/10/2023 | 40.562 | 0,00 |
| EUR 3.300.000 | KBC Group NV RegS FRN 21/1/2028 | 2.896.080 | 0,10 | GBP 350.000 | Trafford Centre Finance Ltd RegS FRN 28/7/2035 | 310.924 | 0,01 |
| EUR 17.246.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,45% 22/6/2043 | 17.391.039 | 0,60 | <hr/> | | | |
| EUR 12.078.000 | Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,30% 22/6/2054 | 11.655.995 | 0,41 | 1.667.502 0,06 | | | |
| <hr/> | | | | Zypern | | | |
| | | | | EUR 1.207.000 | Bank of Cyprus PCL RegS FRN 24/6/2027 | 1.046.155 | 0,04 |
| | | | | EUR 8.694.000 | Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023 | 8.712.866 | 0,30 |
| | | | | EUR 35.975.000 | Cyprus Government International Bond RegS 2,75% 27/6/2024 | 35.874.990 | 1,25 |
| | | | | EUR 44.967.000 | Cyprus Government International Bond RegS 0,625% 3/12/2024 | 43.283.885 | 1,50 |
| <hr/> | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 88.917.896 3,09 | | | |
| Britische Jungferninseln | | | | Dänemark | | | |
| USD 240.000 | Fortune Star BVI Ltd RegS 6,85% 2/7/2024 [*] | 198.856 | 0,01 | EUR 10.200.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 10/11/2024 [*] | 10.025.274 | 0,35 |
| EUR 200.000 | Global Switch Holdings Ltd RegS 2,25% 31/5/2027 | 188.706 | 0,01 | EUR 7.600.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 10/1/2031 | 7.630.020 | 0,26 |
| USD 315.000 | New Metro Global Ltd RegS 4,80% 15/12/2024 | 171.936 | 0,01 | EUR 26.700.000 | Danske Bank A/S RegS FRN 15/5/2031 | 23.556.075 | 0,82 |
| USD 417.000 | Peak RE Bvi Holding Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 314.542 | 0,01 | DKK 0 | Nykredit Realkredit A/S RegS 1,50% 1/10/2053 | — | 0,00 |
| USD 167.025 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd RegS 6,75% 24/4/2033 [*] | 153.260 | 0,00 | EUR 1.725.000 | Orsted A/S RegS FRN 8/12/3022 | 1.718.842 | 0,06 |
| <hr/> | | | | <hr/> | | | |
| | | | | 1.027.300 0,04 | | | |
| Bulgarien | | | | | | | |
| EUR 10.000.000 | Bulgaria Government International Bond RegS 4,125% 23/9/2029 [*] | 9.828.475 | 0,34 | | | | |
| EUR 4.171.000 | Bulgaria Government International Bond RegS 4,50% 27/1/2033 | 4.088.404 | 0,14 | | | | |
| EUR 5.000.000 | Bulgaria Government International Bond RegS 4,625% 23/9/2034 | 4.918.737 | 0,17 | | | | |
| <hr/> | | | | | | | |
| | | | | 18.835.616 0,65 | | | |
| Kanada | | | | | | | |
| EUR 4.730.000 | CPPIB Capital Inc RegS 0,75% 15/7/2049 [*] | 2.644.586 | 0,09 | | | | |
| EUR 5.475.000 | National Bank of Canada RegS 3,50% 25/4/2028 | 5.511.650 | 0,19 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|--|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Dänemark Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | |
| DKK 0 | Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050 | — | 0,00 | EUR 400.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2029 | 398.088 | 0,01 |
| | | 42.930.211 | 1,49 | EUR 7.600.000 | Electricite de France SA RegS 4,625% 25/1/2043 | 7.237.632 | 0,25 |
| | Finnland | | | GBP 400.000 | Electricite de France SA RegS FRN 22/7/2049 | 382.559 | 0,01 |
| EUR 21.081.000 | Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047 | 15.335.163 | 0,53 | EUR 600.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 500.718 | 0,02 |
| EUR 10.250.000 | OP Corporate Bank Plc RegS 0,625% 27/7/2027 [^] | 8.883.777 | 0,31 | EUR 600.000 | Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual) | 457.512 | 0,02 |
| EUR 7.180.000 | OP Corporate Bank Plc RegS FRN 9/6/2030 | 6.649.829 | 0,23 | GBP 10.500.000 | Electricite de France SA RegS FRN 31/12/2099 | 10.970.134 | 0,38 |
| EUR 800.000 | SBB Treasury Oyj RegS 0,75% 14/12/2028 | 509.608 | 0,02 | EUR 1.700.000 | Engie SA RegS 0,375% 26/10/2029 | 1.398.743 | 0,05 |
| EUR 200.000 | SBB Treasury Oyj RegS 1,125% 26/11/2029 | 125.296 | 0,00 | EUR 11.000.000 | Engie SA RegS 4,25% 11/1/2043 [^] | 10.932.350 | 0,38 |
| | | 31.503.673 | 1,09 | EUR 100.000 | Eutelsat SA RegS 2,00% 2/10/2025 | 92.150 | 0,00 |
| | Frankreich | | | EUR 500.000 | Eutelsat SA RegS 1,50% 13/10/2028 | 386.570 | 0,01 |
| EUR 15.700.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 3,375% 25/5/2033 | 15.883.219 | 0,55 | EUR 1.016.908 | FCT Autonoria '2019-1 B' RegS FRN 25/9/2035 | 1.015.509 | 0,04 |
| EUR 986.000 | Air France-KLM RegS 0,125% 25/3/2026 | 169.040 | 0,01 | EUR 75.327 | FCT Autonoria '2019-1 C' RegS FRN 25/9/2035 | 75.033 | 0,00 |
| EUR 200.000 | Air France-KLM RegS 7,25% 31/5/2026 | 205.116 | 0,01 | EUR 56.580 | FCT Autonoria '2019-1 D' RegS FRN 25/9/2035 | 56.059 | 0,00 |
| EUR 1.000.000 | Altice France SA RegS 2,125% 15/2/2025 | 911.280 | 0,03 | EUR 75.213 | FCT Autonoria '2019-1 E' RegS FRN 25/9/2035 | 74.169 | 0,00 |
| EUR 310.000 | Altice France SA RegS 4,25% 15/10/2029 | 225.736 | 0,01 | EUR 75.326 | FCT Autonoria '2019-1 F' RegS FRN 25/9/2035 | 74.057 | 0,00 |
| EUR 600.000 | Atos SE RegS 6/11/2024 (Zero Coupon) | 533.202 | 0,02 | EUR 400.000 | FCT Autonoria '2023- DE C' RegS FRN 26/1/2043 | 399.294 | 0,01 |
| EUR 2.550.000 | AXA SA RegS FRN 11/7/2043 | 2.554.947 | 0,09 | EUR 400.000 | FCT Autonoria '2023-DE D' RegS FRN 26/1/2043 | 397.950 | 0,01 |
| EUR 16.700.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 5,125% 13/1/2033 | 16.652.405 | 0,58 | EUR 200.000 | FCT Autonoria '2023-DE E' RegS FRN 26/1/2043 | 199.230 | 0,01 |
| EUR 273.554 | BNP Paribas SA FRN 29/10/2049 | 205.165 | 0,01 | EUR 100.000 | FCT Autonoria '2023-DE F' RegS FRN 26/1/2043 | 99.637 | 0,00 |
| EUR 22.200.000 | BNP Paribas SA RegS FRN 31/3/2032 | 19.952.250 | 0,69 | EUR 88.597 | FCT E-Carat '10FR B' RegS FRN 20/12/2028 | 88.468 | 0,00 |
| EUR 5.800.000 | Bouygues SA RegS 5,375% 30/6/2042 | 6.348.622 | 0,22 | EUR 22.149 | FCT E-Carat '10FR C' RegS FRN 20/12/2028 | 22.113 | 0,00 |
| EUR 6.500.000 | BPCE SA RegS FRN 2/2/2034 | 5.321.550 | 0,18 | EUR 22.149 | FCT E-Carat '10FR D' RegS FRN 20/12/2028 | 22.114 | 0,00 |
| EUR 7.600.000 | BPCE SA RegS FRN 13/10/2046 | 5.425.260 | 0,19 | EUR 33.224 | FCT E-Carat '10FR E' RegS FRN 20/12/2028 | 33.042 | 0,00 |
| EUR 15.700.000 | BPCE SFH SA RegS 3,125% 20/1/2033 [^] | 15.541.116 | 0,54 | EUR 352.256 | FCT Noria '2018-1 B' RegS FRN 25/6/2038 | 352.353 | 0,01 |
| EUR 15.600.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA RegS 3,125% 23/2/2033 [^] | 15.510.300 | 0,54 | EUR 310.814 | FCT Noria '2018-1 C' RegS FRN 25/6/2038 | 310.959 | 0,01 |
| EUR 2.331.000 | Casino Guichard Perrachon SA FRN 29/1/2049 | 117.482 | 0,00 | EUR 145.047 | FCT Noria '2018-1 D' RegS FRN 25/6/2038 | 144.883 | 0,00 |
| EUR 1.100.000 | Casino Guichard Perrachon SA RegS FRN 31/12/2049 | 51.359 | 0,00 | EUR 155.407 | FCT Noria '2018-1 E' RegS FRN 25/6/2038 | 155.173 | 0,01 |
| EUR 1.100.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023 | 1.091.200 | 0,04 | EUR 1.394.704 | FCT Noria '2021-1 C' RegS FRN 25/10/2049 | 1.372.307 | 0,05 |
| EUR 3.600.000 | Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024 | 3.517.668 | 0,12 | EUR 597.730 | FCT Noria '2021-1 D' RegS FRN 25/10/2049 | 580.219 | 0,02 |
| EUR 5.400.000 | Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 0,875% 29/9/2024 | 5.195.718 | 0,18 | EUR 228.336 | FCT Pixel '2021-1 D' RegS FRN 25/2/2038 | 223.050 | 0,01 |
| EUR 6.400.000 | Credit Agricole SA RegS FRN 12/10/2026 | 6.387.264 | 0,22 | EUR 32.884.000 | France Government Bond OAT RegS (traded in France) 3,00% 25/5/2054 | 30.571.926 | 1,06 |
| GBP 400.000 | Credit Agricole SA RegS 4,875% 23/10/2029 | 443.749 | 0,02 | EUR 7.069.000 | France Government Bond OAT RegS (traded in Germany) 3,00% 25/5/2054 | 6.571.979 | 0,23 |
| EUR 7.600.000 | Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,125% 23/5/2029 | 6.471.324 | 0,22 | EUR 1.115.000 | Goldstory SASU RegS 5,375% 1/3/2026 [^] | 1.064.134 | 0,04 |
| EUR 336.000 | Crown European Holdings SA RegS 3,375% 15/5/2025 | 329.398 | 0,01 | | | | |
| EUR 419.000 | Crown European Holdings SA RegS 5,00% 15/5/2028 | 419.436 | 0,01 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Frankreich Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | |
| EUR 3.084.005 | Harmony French Home Loans FCT '2020-2 A' RegS FRN 27/8/2061 | 3.099.541 | 0,11 | EUR 9.000.000 | Bayerische Landesbank RegS FRN 22/11/2032 | 7.059.240 | 0,25 |
| EUR 4.500.000 | Harmony French Home Loans FCT '2020-2 B' RegS FRN 27/8/2061 | 4.457.960 | 0,15 | EUR 5.800.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA RegS 3,50% 29/5/2029 | 5.703.720 | 0,20 |
| EUR 6.047.011 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 A' RegS FRN 27/5/2061 | 6.080.206 | 0,21 | EUR 296.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH RegS 4,375% 15/1/2028 | 270.870 | 0,01 |
| EUR 600.000 | Harmony French Home Loans FCT '2021-1 B' RegS FRN 27/5/2061 | 586.249 | 0,02 | EUR 4.000.000 | Commerzbank AG RegS FRN 18/1/2030 | 3.997.160 | 0,14 |
| EUR 1.000.000 | Harmony French Home Loans FCT '2022-1 B' RegS FRN 27/5/2062 | 976.257 | 0,03 | EUR 500.000 | DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG RegS 1,875% 15/10/2024 | 364.360 | 0,01 |
| EUR 500.000 | iliad SA RegS 5,375% 14/6/2027 | 496.720 | 0,02 | EUR 5.000.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH RegS 1,125% 29/5/2051^ | 2.850.100 | 0,10 |
| EUR 200.000 | iliad SA RegS 5,625% 15/2/2030 | 193.164 | 0,01 | GBP 3.600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2026 | 3.913.361 | 0,14 |
| GBP 500.000 | Korian SA RegS FRN 31/12/2099 | 464.333 | 0,02 | EUR 9.600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/5/2028 | 8.881.152 | 0,31 |
| EUR 14.500.000 | La Banque Postale SA RegS 4,375% 17/1/2030 | 14.313.530 | 0,50 | EUR 9.600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 5/9/2030 | 9.287.232 | 0,32 |
| EUR 235.000 | La Financiere Atalian SASU RegS 4,00% 15/5/2024 | 178.161 | 0,01 | EUR 1.800.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 19/11/2030 | 1.430.586 | 0,05 |
| EUR 325.000 | La Financiere Atalian SASU RegS 5,125% 15/5/2025 | 226.821 | 0,01 | GBP 6.600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 12/12/2030 | 7.209.081 | 0,25 |
| GBP 300.000 | La Financiere Atalian SASU RegS 6,625% 15/5/2025 | 240.101 | 0,01 | EUR 300.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 19/5/2031 | 291.864 | 0,01 |
| EUR 1.400.000 | Orange SA RegS FRN 31/12/2099 | 1.333.612 | 0,05 | EUR 7.600.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 24/6/2032 | 6.767.648 | 0,24 |
| EUR 609.000 | Picard Groupe SAS RegS 3,875% 1/7/2026 | 555.317 | 0,02 | EUR 400.000 | Deutsche Bank AG RegS FRN 31/12/2099 | 391.536 | 0,01 |
| EUR 1.300.000 | RCI Banque SA RegS FRN 18/2/2030 | 1.199.705 | 0,04 | EUR 7.300.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,25% 27/10/2025 | 6.461.449 | 0,22 |
| EUR 4.500.000 | Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon) | 4.495.635 | 0,16 | EUR 600.000 | DIC Asset AG RegS 2,25% 22/9/2026 | 322.524 | 0,01 |
| USD 360.000 | Societe Generale SA FRN 31/12/2099 | 323.772 | 0,01 | EUR 10.000.000 | E.ON SE RegS 18/12/2023 (Zero Coupon) | 9.821.900 | 0,34 |
| EUR 2.600.000 | Societe Generale SA RegS FRN 6/12/2030 | 2.517.710 | 0,09 | EUR 1.900.000 | Eurogrid GmbH RegS 1,50% 18/4/2028 | 1.728.449 | 0,06 |
| EUR 36.700.000 | Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 2/12/2026 | 32.849.803 | 1,14 | EUR 4.082.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028 | 3.646.532 | 0,13 |
| EUR 16.400.000 | Societe Generale SFH SA RegS 3,125% 24/2/2032 | 16.316.688 | 0,57 | EUR 6.000.000 | Hamburg Commercial Bank AG RegS FRN 22/9/2026 | 5.007.480 | 0,17 |
| EUR 8.400.000 | Teleperformance RegS 3,75% 24/6/2029^ | 8.067.612 | 0,28 | EUR 4.500.000 | Hannover Rueck SE RegS FRN 26/8/2043 | 4.685.580 | 0,16 |
| EUR 200.000 | Tereos Finance Groupe I SA RegS 7,25% 15/4/2028 | 200.728 | 0,01 | EUR 5.067.000 | Heidelberg Materials AG RegS 3,75% 31/5/2032 | 4.901.107 | 0,17 |
| EUR 6.800.000 | TotalEnergies SE RegS FRN 31/12/2099 | 5.938.372 | 0,21 | EUR 650.000 | HT Troplast GmbH RegS 9,25% 15/7/2025 | 646.178 | 0,02 |
| EUR 1.000.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE RegS FRN 31/12/2099^ | 875.870 | 0,03 | EUR 25.000.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 0,01% 5/5/2027^ | 22.365.750 | 0,78 |
| EUR 4.700.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 4.246.826 | 0,15 | EUR 49.816.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 2,00% 15/11/2029 | 47.487.600 | 1,65 |
| EUR 4.900.000 | Veolia Environnement SA RegS FRN 31/12/2099 | 4.042.892 | 0,14 | EUR 8.400.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 1,375% 7/6/2032^ | 7.441.560 | 0,26 |
| EUR 700.000 | Verallia SA RegS 1,875% 10/11/2031 | 572.579 | 0,02 | EUR 9.860.000 | NRW Bank RegS 0,25% 26/1/2032 | 7.850.926 | 0,27 |
| | | 320.974.084 | 11,15 | EUR 300.000 | Peach Property Finance GmbH RegS 4,375% 15/11/2025 | 226.680 | 0,01 |
| | Deutschland | | | EUR 348.042 | Red & Black Auto Germany '8 C' UG RegS FRN 15/9/2030 | 341.736 | 0,01 |
| EUR 100.000 | ADLER Real Estate AG RegS 3,00% 27/4/2026 | 79.221 | 0,00 | EUR 48.646 | Red & Black Auto Germany UG '6 C' RegS FRN 15/10/2028 | 48.484 | 0,00 |
| EUR 4.700.000 | Allianz SE RegS FRN 7/9/2038 | 4.616.575 | 0,16 | EUR 48.646 | Red & Black Auto Germany UG '6 D' RegS FRN 15/10/2028 | 48.241 | 0,00 |
| EUR 5.400.000 | Allianz SE RegS FRN 31/12/2099 | 3.538.350 | 0,12 | EUR 435.053 | Red & Black Auto Germany UG '8 B' RegS FRN 15/9/2030 | 431.818 | 0,02 |
| EUR 6.100.000 | BASF SE RegS 4,25% 8/3/2032 | 6.342.780 | 0,22 | | | | |
| EUR 18.700.000 | Bayer AG RegS 4,625% 26/5/2033 | 19.123.181 | 0,66 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|---------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Indien Fortsetzung | | | |
| EUR 87.011 | Red & Black Auto Germany UG '8 D' RegS FRN 15/9/2030 | 84.653 | 0,00 | USD 400.000 | Power Finance Corp Ltd RegS 4,50% 18/6/2029 | 353.658 | 0,01 |
| EUR 220.000 | Renk AG/Frankfurt am Main RegS 5,75% 15/7/2025 | 216.022 | 0,01 | USD 600.000 | Power Finance Corp Ltd RegS 3,90% 16/9/2029 | 510.091 | 0,02 |
| EUR 9.700.000 | Robert Bosch GmbH RegS 4,375% 2/6/2043 | 9.995.753 | 0,35 | USD 200.000 | REC Ltd RegS 5,625% 11/4/2028 | 187.116 | 0,01 |
| EUR 4.303.000 | RWE AG RegS 2,75% 24/5/2030 | 3.992.151 | 0,14 | USD 375.000 | Summit Digital Infrastructure Ltd RegS 2,875% 12/8/2031 | 280.719 | 0,01 |
| EUR 6.390.000 | State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 3,40% 7/3/2073 | 6.601.381 | 0,23 | | | 1.464.303 | 0,05 |
| EUR 196.940 | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH RegS 6,00% 30/7/2026 | 192.710 | 0,01 | Indonesien | | | |
| EUR 1.415.000 | Tele Columbus AG RegS 3,875% 2/5/2025* | 953.866 | 0,03 | USD 200.000 | Indonesia Government International Bond 5,45% 20/9/2052 | 190.146 | 0,01 |
| EUR 1.200.000 | Vonovia SE RegS 5,00% 23/11/2030* | 1.154.328 | 0,04 | USD 510.000 | Pertamina Geothermal Energy PT RegS 5,15% 27/4/2028* | 477.640 | 0,01 |
| EUR 500.000 | ZF Finance GmbH RegS 5,75% 3/8/2026 | 503.390 | 0,02 | | | 667.786 | 0,02 |
| | | 239.276.265 | 8,31 | International | | | |
| Hongkong | | | | EUR 881.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc RegS 2,125% 15/8/2026* | 784.909 | 0,03 |
| USD 400.000 | AIA Group Ltd RegS 4,95% 4/4/2033 | 378.051 | 0,01 | GBP 299.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc RegS 4,75% 15/7/2027 | 281.370 | 0,01 |
| USD 250.000 | Bank of East Asia Ltd RegS FRN 22/4/2032 | 209.394 | 0,01 | EUR 597.000 | Clarios Global LP / Clarios US Finance Co RegS 4,375% 15/5/2026 | 573.411 | 0,02 |
| USD 284.000 | Bank of East Asia Ltd RegS FRN 31/12/2099* | 238.213 | 0,01 | | | 1.639.690 | 0,06 |
| EUR 8.475.000 | Hong Kong Government International Bond RegS 3,875% 11/1/2025 | 8.469.703 | 0,29 | Irland | | | |
| USD 160.000 | Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd FRN (Perpetual) | 148.757 | 0,01 | EUR 3.005.000 | Abbott Ireland Financing DAC RegS 0,10% 19/11/2024 | 2.859.044 | 0,10 |
| USD 250.000 | Nanyang Commercial Bank Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 227.103 | 0,01 | GBP 4.761.221 | Agora Securities UK '2021-1X A' DAC RegS FRN 22/7/2031 | 5.340.541 | 0,19 |
| USD 227.000 | Yango Justice International Ltd 10,25% 15/9/2023 | 3.720 | 0,00 | EUR 2.900.000 | AIB Group Plc RegS FRN 23/7/2029 | 2.862.735 | 0,10 |
| USD 227.000 | Yango Justice International Ltd RegS 8,25% 25/11/2023 | 3.720 | 0,00 | EUR 1.060.000 | AIB Group Plc RegS FRN (Perpetual) | 990.284 | 0,03 |
| USD 284.000 | Yango Justice International Ltd RegS 7,50% 15/4/2024 | 4.655 | 0,00 | EUR 400.000 | AlbaCore Euro CLO '4X D' DAC RegS FRN 15/7/2035 | 380.430 | 0,01 |
| USD 200.000 | Yanlord Land HK Co Ltd RegS 5,125% 20/5/2026 | 142.087 | 0,00 | EUR 490.000 | Aqueduct European CLO '2022-7X A' DAC RegS FRN 15/3/2036 | 488.555 | 0,02 |
| | | 9.825.403 | 0,34 | EUR 150.000 | Aurium CLO '2X ERR' DAC RegS FRN 22/6/2034 | 133.348 | 0,01 |
| Ungarn | | | | EUR 399.418 | Aurium CLO '4X AR' DAC RegS FRN 16/1/2031 | 391.624 | 0,01 |
| EUR 11.800.000 | Erste Bank Hungary Zrt RegS FRN 4/2/2026 | 10.787.560 | 0,38 | EUR 700.000 | Aurium Clo '8X A' DAC RegS FRN 23/6/2034 | 677.280 | 0,02 |
| EUR 18.975.000 | Hungary Government International Bond RegS 5,00% 22/2/2027 | 19.046.014 | 0,66 | EUR 100.000 | Avoca CLO XIV DAC '14X ER' RegS FRN 12/1/2031 | 89.874 | 0,00 |
| USD 16.525.000 | MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt RegS 6,50% 29/6/2028 | 15.515.163 | 0,54 | EUR 100.000 | Avoca CLO XIV DAC '14X FR' RegS FRN 12/1/2031 | 85.191 | 0,00 |
| | | 45.348.737 | 1,58 | EUR 275.000 | Avoca CLO XIV DAC '14X SUB' RegS 12/1/2031 (Zero Coupon) | 115.215 | 0,00 |
| Island | | | | EUR 500.000 | Avoca CLO XV DAC '15X FR' RegS FRN 15/4/2031 | 403.957 | 0,01 |
| EUR 3.375.000 | Iceland Government International Bond RegS 0,625% 3/6/2026 | 3.092.513 | 0,11 | EUR 150.000 | BBAM European CLO '1X ER' DAC RegS FRN 22/7/2034 | 133.979 | 0,01 |
| EUR 3.275.000 | Iceland Government International Bond RegS 15/4/2028 (Zero Coupon) | 2.774.154 | 0,09 | EUR 150.000 | BlueMountain EUR '2021-1X E' CLO DAC RegS FRN 15/4/2034 | 130.075 | 0,00 |
| | | 5.866.667 | 0,20 | EUR 1.100.000 | Bridgepoint CLO '4X A' DAC RegS FRN 20/1/2037 | 1.101.965 | 0,04 |
| Indien | | | | EUR 725.000 | Capital Four CLO '5X A' DAC RegS FRN 25/4/2036 | 720.983 | 0,03 |
| USD 168.000 | JSW Hydro Energy Ltd RegS 4,125% 18/5/2031 | 132.719 | 0,00 | EUR 150.000 | CIFC European Funding CLO '3X E' DAC RegS FRN 15/1/2034 | 133.041 | 0,01 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|--|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Irland Fortsetzung | | | | Irland Fortsetzung | | |
| EUR 873.000 | CIFC European Funding CLO '4X A' DAC RegS FRN 18/8/2035 | 847.176 | 0,03 | GBP 9.365.006 | Taurus '2019-UK2 A' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 10.727.065 | 0,37 |
| EUR 1.100.000 | Contego CLO '6X AR' DAC RegS FRN 15/4/2034 | 1.066.942 | 0,04 | GBP 3.319.543 | Taurus '2019-UK2 B' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 3.752.311 | 0,13 |
| EUR 350.000 | CVC Cordatus Loan Fund '27X D2' DAC RegS FRN 15/4/2035 | 346.500 | 0,01 | GBP 2.075.308 | Taurus '2019-UK2 C' DAC RegS FRN 17/11/2029 | 2.327.723 | 0,08 |
| EUR 7.208.917 | Haus European Loan Conduit '39X A1' DAC RegS FRN 28/7/2051 | 6.776.382 | 0,24 | GBP 1.602.232 | Taurus '2021-UK1X A' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 1.790.588 | 0,06 |
| EUR 1.038.700 | Haus European Loan Conduit '39X B' DAC RegS FRN 28/7/2051 | 910.161 | 0,03 | GBP 879.540 | Taurus '2021-UK1X B' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 963.614 | 0,03 |
| EUR 840.757 | Haus European Loan Conduit '39X C' DAC RegS FRN 28/7/2051 | 727.255 | 0,03 | GBP 536.063 | Taurus '2021-UK1X C' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 579.847 | 0,02 |
| EUR 204.043 | Invesco Euro Clo '3X F' DAC RegS FRN 15/7/2032 | 180.679 | 0,01 | GBP 546.983 | Taurus '2021-UK1X D' DAC RegS FRN 17/5/2031 | 595.622 | 0,02 |
| EUR 500.000 | Invesco Euro CLO '9X A' DAC RegS FRN 20/4/2036 | 496.547 | 0,02 | GBP 2.566.386 | Taurus '2021-UK4X A' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 2.849.284 | 0,10 |
| EUR 1.331.397 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC '1X C' RegS FRN 17/8/2033 | 1.182.733 | 0,04 | GBP 1.666.131 | Taurus '2021-UK4X C' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 1.820.566 | 0,06 |
| EUR 1.007.384 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC '1X D' RegS FRN 17/8/2033 | 898.652 | 0,03 | GBP 552.437 | Taurus '2021-UK4X D' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 592.371 | 0,02 |
| EUR 7.387.479 | Last Mile Securities PE '2021- 1X A1' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 7.152.446 | 0,25 | EUR 1.100.000 | Tikehau CLO '7X A' DAC RegS FRN 20/10/2035 | 1.095.827 | 0,04 |
| EUR 1.987.591 | Last Mile Securities PE '2021- 1X A2' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 1.886.621 | 0,07 | EUR 8.133.144 | Vita Scientia '2022-1X A' DAC RegS FRN 27/2/2033 | 7.868.817 | 0,27 |
| EUR 938.807 | Last Mile Securities PE '2021- 1X B' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 885.107 | 0,03 | | | 100.456.970 | 3,49 |
| EUR 1.060.782 | Last Mile Securities PE '2021- 1X C' DAC RegS FRN 17/8/2031 | 978.571 | 0,03 | | Italien | | |
| EUR 1.300.000 | LT Autorahoitus '3 B' DAC RegS FRN 17/12/2032 | 1.313.910 | 0,05 | EUR 3.125.000 | A2A SpA RegS 4,375% 3/2/2034 | 3.116.094 | 0,11 |
| EUR 5.000.000 | Lt Autorahoitus '4 A' DAC RegS FRN 18/7/2033 | 5.005.292 | 0,17 | EUR 191.855 | Asset-Backed European Securitisation Transaction '17 B' Srl RegS FRN 15/4/2032 | 191.531 | 0,01 |
| EUR 800.000 | Lt Autorahoitus '4 B' DAC RegS FRN 18/7/2033 | 801.874 | 0,03 | EUR 94.452 | Asset-Backed European Securitisation Transaction '17 C' Srl RegS FRN 15/4/2032 | 94.400 | 0,00 |
| EUR 976.000 | Margay CLO '1X A' DAC RegS FRN 15/7/2036 | 976.000 | 0,03 | EUR 88.549 | Asset-Backed European Securitisation Transaction '17 D' Srl RegS FRN 15/4/2032 | 88.601 | 0,00 |
| EUR 100.000 | Margay CLO '1X D' DAC RegS FRN 15/7/2036 | 100.000 | 0,00 | EUR 29.516 | Asset-Backed European Securitisation Transaction '17 E' Srl RegS FRN 15/4/2032 | 29.515 | 0,00 |
| EUR 150.000 | Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO '2021-1X E' RegS FRN 17/4/2034 | 133.763 | 0,01 | EUR 2.500.000 | ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028 | 2.215.975 | 0,08 |
| EUR 1.500.000 | Palmer Square European CLO '2023-1X A' DAC RegS FRN 15/7/2036 | 1.501.425 | 0,05 | EUR 3.604.000 | ASTM SpA RegS 1,50% 25/1/2030 | 2.930.196 | 0,10 |
| EUR 100.000 | Palmer Square European CLO '2023-1X D' DAC RegS FRN 15/7/2036 | 100.000 | 0,00 | EUR 9.625.000 | ASTM SpA RegS 2,375% 25/11/2033 | 7.510.195 | 0,26 |
| EUR 10.238.261 | Pearl Finance '2020-1 A1' DAC RegS FRN 17/11/2032 | 10.033.496 | 0,35 | EUR 1.769.768 | AutoFlorence '1 A' Srl RegS FRN 25/12/2042 | 1.770.520 | 0,06 |
| EUR 1.128.144 | Pearl Finance '2020-1 A2' DAC RegS FRN 17/11/2032 | 1.108.965 | 0,04 | EUR 268.087 | AutoFlorence '1 B' Srl RegS FRN 25/12/2042 | 267.494 | 0,01 |
| EUR 1.354.717 | Pearl Finance '2020-1 B' DAC RegS FRN 17/11/2032 | 1.327.622 | 0,05 | EUR 699.006 | Autoflorence '2 B' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 686.897 | 0,02 |
| EUR 536.962 | River Green Finance '2020-1 B' DAC RegS FRN 22/1/2032 | 500.986 | 0,02 | EUR 322.259 | Autoflorence '2 C' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 311.887 | 0,01 |
| EUR 319.275 | River Green Finance '2020-1 C' DAC RegS FRN 22/1/2032 | 293.878 | 0,01 | EUR 172.805 | Autoflorence '2 D' Srl RegS FRN 24/12/2044 | 168.706 | 0,01 |
| EUR 927.815 | SCF Rahoituspalvelut IX DAC 'B' RegS FRN 25/10/2030 | 922.231 | 0,03 | EUR 563.000 | AutoFlorence '3 B' Srl RegS FRN 25/12/2046 | 563.000 | 0,02 |
| | | | | EUR 222.000 | AutoFlorence '3 C' Srl RegS FRN 25/12/2046 | 222.000 | 0,01 |
| | | | | EUR 229.000 | AutoFlorence '3 D' Srl RegS FRN 25/12/2046 | 229.000 | 0,01 |
| | | | | EUR 1.289.000 | Azzurra Aeroporti SpA RegS 2,125% 30/5/2024 | 1.250.240 | 0,04 |
| | | | | EUR 322.000 | Azzurra Aeroporti SpA RegS 2,625% 30/5/2027 | 286.818 | 0,01 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------------------|---|------------------------|--------------------|------------------|---|------------------------|--------------------|
| Italien Fortsetzung | | | | Japan | | | |
| EUR 475.000 | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS FRN 2/3/2026 | 474.872 | 0,02 | USD 470.000 | Asahi Mutual Life Insurance Co RegS FRN 31/12/2099 | 438.849 | 0,01 |
| EUR 1.440.000 | Banco BPM SpA RegS FRN 29/6/2031 | 1.259.957 | 0,04 | EUR 1.400.000 | SoftBank Group Corp RegS 2,125% 6/7/2024 | 1.355.760 | 0,05 |
| EUR 207.000 | Banco BPM SpA RegS FRN 19/1/2032 | 181.086 | 0,01 | EUR 352.000 | SoftBank Group Corp RegS 3,125% 19/9/2025 | 330.545 | 0,01 |
| EUR 143.000 | Brignole Co '2021 B' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 141.497 | 0,01 | EUR 305.000 | SoftBank Group Corp RegS 3,875% 6/7/2032 | 230.220 | 0,01 |
| EUR 100.000 | Brignole Co '2021 D' Srl RegS FRN 24/7/2036 | 97.380 | 0,00 | USD 506.000 | SoftBank Group Corp RegS FRN 31/12/2099 | 472.316 | 0,02 |
| EUR 15.000.000 | Cassa Depositi e Prestiti SpA RegS 3,50% 19/9/2027 | 14.766.150 | 0,51 | | | 2.827.690 | 0,10 |
| EUR 2.300.016 | Cassia '2022-1 A' Srl RegS FRN 22/5/2034 | 2.182.716 | 0,08 | Jersey | | | |
| EUR 1.099.856 | Cassia '2022-1X B' Srl RegS FRN 22/5/2034 | 1.018.248 | 0,04 | GBP 500.430 | AA Bond Co Ltd RegS 4,875% 31/7/2024 | 576.416 | 0,02 |
| EUR 100.000 | Cedacri Mergesco SPA RegS FRN 15/5/2028 | 97.495 | 0,00 | GBP 400.000 | Cornwall Jersey Ltd RegS 0,75% 16/4/2026 | 309.830 | 0,01 |
| EUR 286.000 | Cedacri Mergesco SPA RegS FRN 15/5/2028 | 271.322 | 0,01 | GBP 1.500.000 | CPUK Finance Ltd RegS 4,875% 28/8/2025 | 1.656.027 | 0,06 |
| EUR 655.000 | Centurion Bidco SpA RegS 11,125% 15/5/2028 | 664.511 | 0,02 | GBP 300.000 | CPUK Finance Ltd RegS 4,50% 28/8/2027 | 296.880 | 0,01 |
| EUR 4.900.000 | Enel SpA RegS FRN 31/12/2099 | 4.933.369 | 0,17 | GBP 800.000 | Galaxy Bidco Ltd RegS 6,50% 31/7/2026 | 844.705 | 0,03 |
| EUR 6.044.000 | Eni SpA RegS FRN 31/12/2099 | 5.611.068 | 0,19 | GBP 1.490.509 | Intu Jersey 2 Ltd RegS 2,875% 1/11/2023 | 309.490 | 0,01 |
| EUR 993.000 | Eni SpA RegS FRN (Perpetual) | 838.013 | 0,03 | | | 3.993.348 | 0,14 |
| EUR 739.000 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA RegS 1,625% 21/10/2028 | 656.217 | 0,02 | Luxemburg | | | |
| EUR 119.000 | Inter Media and Communication SpA RegS 6,75% 9/2/2027 | 113.618 | 0,00 | EUR 1.224.000 | Adler Financing Sarl RegS 12,50% 30/6/2025 | 1.271.650 | 0,04 |
| GBP 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA RegS 5,148% 10/6/2030 | 190.384 | 0,01 | EUR 300.000 | ADLER Group SA RegS 2,00% 23/11/2023 | 277.347 | 0,01 |
| EUR 20.000.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,50% 1/12/2024 | 19.762.600 | 0,69 | EUR 875.000 | Altice Financing SA RegS 2,25% 15/1/2025 | 812.560 | 0,03 |
| EUR 20.000.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,50% 15/11/2025 | 19.630.000 | 0,68 | EUR 220.000 | Altice Financing SA RegS 3,00% 15/1/2028 | 169.831 | 0,01 |
| EUR 30.000.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,60% 22/11/2028 | 29.772.000 | 1,03 | EUR 645.000 | Altice Financing SA RegS 4,25% 15/8/2029 | 495.083 | 0,02 |
| EUR 25.792.386 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,40% 15/5/2039 | 26.697.699 | 0,93 | EUR 300.000 | Aroundtown SA RegS 2,00% 2/11/2026 | 246.375 | 0,01 |
| EUR 700.000 | Nexi SpA RegS 24/2/2028 (Zero Coupon) | 525.511 | 0,02 | EUR 300.000 | Aroundtown SA RegS 0,375% 15/4/2027 | 210.087 | 0,01 |
| EUR 2.129.414 | Progetto Quinto '1 A' Srl RegS FRN 27/10/2036 | 2.117.780 | 0,07 | EUR 600.000 | Aroundtown SA RegS 1,45% 9/7/2028 | 394.470 | 0,01 |
| EUR 599.000 | Red & Black Auto Italy '1 D' Srl RegS FRN 28/12/2031 | 575.479 | 0,02 | EUR 300.000 | Aroundtown SA RegS FRN 31/12/2099 | 123.378 | 0,00 |
| EUR 414.000 | Rekeep SpA RegS 7,25% 1/2/2026 | 376.616 | 0,01 | GBP 427.000 | Aroundtown SA RegS FRN 31/12/2099 | 166.716 | 0,00 |
| EUR 584.000 | Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030 | 471.738 | 0,02 | EUR 4.060.000 | BL Consumer Credit '2021-1 A' RegS FRN 25/9/2038 | 4.066.970 | 0,14 |
| EUR 287.000 | Telecom Italia SpA RegS 2,375% 12/10/2027 | 247.913 | 0,01 | EUR 528.000 | BL Consumer Credit '2021-1 C' RegS FRN 25/9/2038 | 522.368 | 0,02 |
| EUR 1.140.000 | Telecom Italia SpA RegS 6,875% 15/2/2028 | 1.144.845 | 0,04 | EUR 681.000 | BL Consumer Credit '2021-1 D' RegS FRN 25/9/2038 | 667.161 | 0,02 |
| EUR 726.000 | Telecom Italia SpA RegS 1,625% 18/1/2029 | 562.207 | 0,02 | EUR 355.000 | BL Consumer Credit '2021-1 E' RegS FRN 25/9/2038 | 342.172 | 0,01 |
| EUR 325.000 | UniCredit SpA RegS FRN 16/2/2029 | 316.082 | 0,01 | EUR 5.100.000 | Bumper De SA '2023-DE1 A' RegS FRN 23/8/2032 | 5.107.545 | 0,18 |
| EUR 229.000 | UniCredit SpA RegS FRN (Perpetual) | 229.066 | 0,01 | GBP 561.000 | Cidron Aida Finco Sarl RegS 6,25% 1/4/2028 | 571.322 | 0,02 |
| | | 157.860.508 | 5,48 | EUR 662.000 | Cullinan Holdco Scsp RegS 4,625% 15/10/2026 | 562.740 | 0,02 |
| | | | | EUR 253.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl RegS 8,50% 15/7/2031 | 252.555 | 0,01 |
| | | | | EUR 32.000.000 | European Financial Stability Facility RegS 3,00% 15/12/2028 | 32.129.600 | 1,12 |
| | | | | EUR 1.300.000 | European TopSoho Sarl RegS 4,00% 21/9/2023 | 1.072.370 | 0,04 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Luxemburg Fortsetzung | | | | Montenegro | | |
| EUR 800.000 | FACT Master SA '2021-1 B' RegS FRN 20/7/2028 | 791.965 | 0,03 | EUR 2.000.000 | Montenegro Government International Bond RegS 3,375% 21/4/2025^ | 1.878.575 | 0,07 |
| EUR 1.557.000 | Garfunkelux Holdco 3 SA RegS 6,75% 1/11/2025 | 1.142.153 | 0,04 | EUR 34.793.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027 | 28.589.147 | 0,99 |
| GBP 100.000 | Garfunkelux Holdco 3 SA RegS 7,75% 1/11/2025 | 83.304 | 0,00 | EUR 4.900.000 | Montenegro Government International Bond RegS 2,55% 3/10/2029^ | 3.661.488 | 0,13 |
| EUR 550.000 | Kleopatra Holdings 2 SCA RegS 6,50% 1/9/2026 | 362.610 | 0,01 | | | 34.129.210 | 1,19 |
| EUR 3.820.000 | Medtronic Global Holdings SCA 2,25% 7/3/2039 | 3.054.205 | 0,11 | | Niederlande | | |
| EUR 284.000 | Monitchem HoldCo 3 SA RegS 8,75% 1/5/2028 | 285.142 | 0,01 | GBP 5.300.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 5,25% 26/5/2026 | 6.065.739 | 0,21 |
| EUR 832.000 | Rossini Sarl RegS 6,75% 30/10/2025 | 840.370 | 0,03 | EUR 6.100.000 | ABN AMRO Bank NV RegS 4,375% 20/10/2028 | 6.099.695 | 0,21 |
| EUR 2.491.561 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 B' RegS FRN 14/11/2034 | 2.471.255 | 0,08 | USD 500.000 | AT Securities BV RegS FRN 31/12/2099 | 163.868 | 0,00 |
| EUR 1.132.528 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 C' RegS FRN 14/11/2034 | 1.119.524 | 0,04 | EUR 400.000 | ATF Netherlands BV RegS FRN 29/12/2049 | 173.820 | 0,01 |
| EUR 634.216 | SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 D' RegS FRN 14/11/2034 | 623.292 | 0,02 | EUR 600.000 | Cooperatieve Rabobank UA RegS FRN 25/4/2029 | 601.218 | 0,02 |
| EUR 4.175.000 | SELP Finance Sarl RegS 3,75% 10/8/2027 | 3.898.949 | 0,13 | EUR 10.000.000 | CRH Funding BV RegS 1,875% 9/1/2024 | 9.884.600 | 0,34 |
| EUR 8.255.000 | SES SA RegS FRN 31/12/2099 | 6.809.549 | 0,24 | EUR 6.000.000 | de Volksbank NV RegS FRN 4/5/2027 | 5.637.300 | 0,20 |
| EUR 521.000 | Summer BC Holdco B Sarl RegS 5,75% 31/10/2026 | 461.022 | 0,02 | EUR 3.658.744 | Domi '2021-1 A' BV RegS FRN 15/6/2053 | 3.632.525 | 0,13 |
| EUR 300.000 | Vivion Investments Sarl RegS 3,00% 8/8/2024 | 235.521 | 0,01 | EUR 8.927.396 | Domi '2022-1 A' BV RegS FRN 15/4/2054 | 8.896.264 | 0,31 |
| EUR 900.000 | Vivion Investments Sarl RegS 3,50% 1/11/2025 | 587.952 | 0,02 | EUR 330.000 | Domi '2023-1 B' BV RegS FRN 15/2/2055 | 325.897 | 0,01 |
| | | 72.229.113 | 2,51 | EUR 3.433.408 | Dutch Property Finance '2020-2 A' BV RegS FRN 28/1/2058 | 3.431.131 | 0,12 |
| | Mazedonien | | | EUR 290.000 | Dutch Property Finance '2020-2 B' BV RegS FRN 28/1/2058 | 288.971 | 0,01 |
| EUR 13.000.000 | North Macedonia Government International Bond RegS 6,96% 13/3/2027^ | 13.274.722 | 0,46 | EUR 4.809.074 | Dutch Property Finance '2021-1 A' BV RegS FRN 28/7/2058 | 4.787.625 | 0,17 |
| | | 13.274.722 | 0,46 | EUR 739.000 | Dutch Property Finance '2021-1 B' BV RegS FRN 28/7/2058 | 730.407 | 0,02 |
| | Malaysia | | | EUR 820.000 | Dutch Property Finance '2021-2 B' BV RegS FRN 28/4/2059 | 800.799 | 0,03 |
| USD 280.000 | Dua Capital Ltd RegS 2,78% 11/5/2031 | 227.256 | 0,01 | EUR 504.000 | Dutch Property Finance '2021-2 C' BV RegS FRN 28/4/2059 | 484.146 | 0,02 |
| USD 885.000 | Khazanah Capital Ltd RegS 4,876% 1/6/2033 | 837.317 | 0,03 | EUR 3.199.745 | Dutch Property Finance '2023-1 A' BV RegS FRN 28/4/2064 | 3.201.265 | 0,11 |
| USD 895.000 | Khazanah Global Sukuk Bhd RegS 4,687% 1/6/2028 | 841.241 | 0,03 | GBP 2.100.000 | E.ON International Finance BV RegS 5,875% 30/10/2037 | 2.369.005 | 0,08 |
| USD 400.000 | MISC Capital Two Labuan Ltd RegS 3,75% 6/4/2027 | 354.341 | 0,01 | EUR 3.725.000 | ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN 31/12/2099 | 3.571.716 | 0,12 |
| | | 2.260.155 | 0,08 | EUR 13.550.000 | Enel Finance International NV RegS 28/5/2026 (Zero Coupon) | 12.158.279 | 0,42 |
| | Marshall-Inseln | | | USD 9.070.000 | Enel Finance International NV RegS 7,50% 14/10/2032 | 9.433.651 | 0,33 |
| USD 312.000 | Danaos Corp 8,50% 1/3/2028 | 291.388 | 0,01 | USD 1.700.000 | Enel Finance International NV RegS 7,75% 14/10/2052 | 1.825.168 | 0,06 |
| | | 291.388 | 0,01 | EUR 713.000 | Ferrovial Netherlands BV RegS FRN 31/12/2099 | 695.296 | 0,02 |
| | Mauritius | | | EUR 200.000 | Goodyear Europe BV RegS 2,75% 15/8/2028 | 168.534 | 0,01 |
| USD 200.000 | CA Magnum Holdings RegS 5,375% 31/10/2026 | 163.307 | 0,00 | | | | |
| USD 200.000 | Greenko Solar Mauritius Ltd RegS 5,95% 29/7/2026 | 173.874 | 0,00 | | | | |
| USD 200.000 | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd RegS 5,50% 6/4/2025 | 177.950 | 0,01 | | | | |
| USD 250.000 | India Green Energy Holdings RegS 5,375% 29/4/2024 | 227.517 | 0,01 | | | | |
| USD 200.000 | Network i2i Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 181.369 | 0,01 | | | | |
| | | 924.017 | 0,03 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|--|------------------------|--------------------|----------------|--|------------------------|--------------------|
| | Niederlande Fortsetzung | | | | Neuseeland Fortsetzung | | |
| EUR 3.500.000 | Iberdrola International BV RegS FRN 31/12/2099 | 3.403.050 | 0,12 | NZD 42.000.000 | New Zealand Government Bond 4,50% 15/5/2030 | 23.984.360 | 0,83 |
| EUR 2.100.000 | ING Groep NV RegS FRN 16/2/2027 | 1.934.982 | 0,07 | NZD 9.340.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,00% 20/9/2025 | 6.713.834 | 0,23 |
| EUR 1.100.000 | ING Groep NV RegS FRN 1/2/2030 | 876.249 | 0,03 | NZD 4.926.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040 | 3.413.752 | 0,12 |
| EUR 14.700.000 | ING Groep NV RegS (traded in Germany) FRN 18/2/2029 | 12.143.964 | 0,42 | | | 61.300.712 | 2,13 |
| EUR 4.200.000 | ING Group NV RegS FRN 23/5/2034 | 4.240.404 | 0,15 | | Norwegen | | |
| EUR 1.735.818 | Jubilee Place '2020-1 A' BV RegS FRN 17/10/2057 | 1.738.659 | 0,06 | EUR 15.100.000 | DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023 | 14.855.229 | 0,51 |
| EUR 4.097.697 | Jubilee Place '2021-1 A' BV RegS FRN 17/7/2058 | 4.085.284 | 0,14 | EUR 12.850.000 | DNB Bank ASA RegS FRN 21/9/2027 | 12.591.073 | 0,44 |
| EUR 5.316.148 | Jubilee Place '3 A' RegS FRN 17/1/2059 | 5.304.847 | 0,18 | EUR 1.000.000 | Explorer II AS 3,375% 24/2/2025 | 921.190 | 0,03 |
| EUR 407.000 | Jubilee Place '3 B' RegS FRN 17/1/2059 | 395.258 | 0,01 | USD 3.205.000 | Norske Skogindustrier ASA 7,125% 15/10/2033 | 540 | 0,00 |
| EUR 201.000 | Jubilee Place '3 C' RegS FRN 17/1/2059 | 192.779 | 0,01 | EUR 18.240.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 1,75% 11/5/2032^ | 16.152.067 | 0,56 |
| EUR 166.386 | Magoi '2019-1 B' BV RegS FRN 27/7/2039 | 165.374 | 0,01 | EUR 7.200.000 | Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon) | 7.115.112 | 0,25 |
| EUR 55.420 | Magoi '2019-1 C' BV RegS FRN 27/7/2039 | 54.623 | 0,00 | | | 51.635.211 | 1,79 |
| EUR 27.777 | Magoi '2019-1 D' BV RegS FRN 27/7/2039 | 27.271 | 0,00 | | Panama | | |
| EUR 27.777 | Magoi '2019-1 E' BV RegS FRN 27/7/2039 | 27.090 | 0,00 | EUR 167.000 | Carnival Corp RegS 10,125% 1/2/2026 | 176.103 | 0,00 |
| EUR 2.100.000 | Naturgy Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 1.841.070 | 0,06 | EUR 500.000 | Carnival Corp RegS 7,625% 1/3/2026 | 468.125 | 0,02 |
| EUR 13.300.000 | Niederlande Waterschapsbank NV RegS 3,00% 20/4/2033 | 13.272.735 | 0,46 | | | 644.228 | 0,02 |
| EUR 611.000 | Repsol International Finance BV RegS FRN 31/12/2099 | 551.562 | 0,02 | | Philippinen | | |
| EUR 6.491.000 | Shell International Finance BV RegS 1,875% 7/4/2032 | 5.659.568 | 0,20 | USD 200.000 | Globe Telecom Inc RegS FRN 31/12/2099 | 174.627 | 0,00 |
| EUR 2.572.615 | Silver Arrow Athlon NL '2021-1 A' BV RegS FRN 26/4/2031 | 2.577.722 | 0,09 | USD 227.000 | Rizal Commercial Banking Corp RegS FRN 31/12/2099 | 189.428 | 0,01 |
| EUR 707.691 | Summer BidCo BV RegS 9,00% 15/11/2025^ | 621.006 | 0,02 | | | 364.055 | 0,01 |
| EUR 118.442 | Summer BidCo BV RegS 9,00% 15/11/2025 | 103.636 | 0,00 | | Polen | | |
| EUR 800.000 | Telefonica Europe BV RegS FRN 31/12/2099 | 791.456 | 0,03 | USD 3.950.000 | Bank Gospodarstwa Krajowego RegS 5,375% 22/5/2033 | 3.710.929 | 0,13 |
| EUR 11.475.000 | TenneT Holding BV RegS 4,50% 28/10/2034^ | 12.328.396 | 0,43 | EUR 2.425.000 | Republic of Poland Government International Bond RegS 4,25% 14/2/2043 | 2.343.132 | 0,08 |
| EUR 856.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7,375% 15/9/2029 | 867.145 | 0,03 | | | 6.054.061 | 0,21 |
| EUR 6.154.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7,875% 15/9/2031 | 6.302.250 | 0,22 | | Portugal | | |
| EUR 200.000 | United Group BV RegS 4,875% 1/7/2024 | 198.978 | 0,01 | EUR 120.676 | Ares Lusitani-STC SA / Pelican Finance '2 C' RegS FRN 25/1/2035 | 117.773 | 0,00 |
| EUR 9.950.000 | Universal Music Group NV RegS (traded in International) 3,75% 30/6/2032 | 9.781.646 | 0,34 | EUR 844.730 | Ares Lusitani-STC SA / Pelican Finance '2 D' RegS FRN 25/1/2035 | 807.247 | 0,03 |
| EUR 1.393.000 | VZ Vendor Financing II BV RegS 2,875% 15/1/2029 | 1.044.095 | 0,04 | EUR 25.091 | SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance '1 B' RegS FRN 20/3/2033 | 25.104 | 0,00 |
| EUR 2.250.000 | Wolters Kluwer NV RegS 3,75% 3/4/2031^ | 2.263.073 | 0,08 | EUR 800.000 | SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance '1 C' RegS FRN 20/3/2033 | 800.241 | 0,03 |
| | | 178.221.091 | 6,19 | EUR 742.615 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance '2 D' RegS FRN 23/9/2032 | 686.102 | 0,02 |
| | Neuseeland | | | EUR 157.540 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance '1 B' RegS FRN 28/10/2040 | 150.878 | 0,00 |
| EUR 9.270.000 | ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031 | 7.255.444 | 0,25 | | | | |
| EUR 10.245.000 | Chorus Ltd 3,625% 7/9/2029 | 10.036.822 | 0,35 | | | | |
| EUR 10.000.000 | Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023 | 9.896.500 | 0,35 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------|---|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Portugal Fortsetzung | | | | Spanien Fortsetzung | | |
| EUR 551.389 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance '1 C' RegS FRN 28/10/2040 | 525.145 | 0,02 | EUR 156.081 | Autonomia Spain '2019-SP C' RegS FRN 27/12/2035 | 154.805 | 0,01 |
| EUR 5.125.422 | TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta '7 SEN' RegS 0,70% 12/2/2024 | 5.047.981 | 0,18 | EUR 93.649 | Autonomia Spain '2019-SP D' RegS FRN 27/12/2035 | 92.265 | 0,00 |
| | | 8.160.471 | 0,28 | EUR 93.649 | Autonomia Spain '2019-SP E' RegS FRN 27/12/2035 | 91.527 | 0,00 |
| | Rumänien | | | EUR 62.433 | Autonomia Spain '2019-SP F' RegS FRN 27/12/2035 | 60.540 | 0,00 |
| EUR 900.000 | RCS & RDS SA RegS 2,50% 5/2/2025 | 856.624 | 0,03 | EUR 5.344.287 | Autonomia Spain '2021-SP A' FT RegS FRN 31/1/2039 | 5.350.599 | 0,19 |
| | | 856.624 | 0,03 | EUR 1.617.350 | Autonomia Spain '2021-SP B' FT RegS FRN 31/1/2039 | 1.598.864 | 0,06 |
| | San Marino | | | EUR 1.476.711 | Autonomia Spain '2021-SP C' FT RegS FRN 31/1/2039 | 1.448.670 | 0,05 |
| EUR 10.000.000 | San Marino Government Bond RegS 6,50% 19/1/2027 | 10.056.600 | 0,35 | EUR 632.876 | Autonomia Spain '2021-SP D' FT RegS FRN 31/1/2039 | 615.048 | 0,02 |
| | | 10.056.600 | 0,35 | EUR 351.598 | Autonomia Spain '2021-SP E' FT RegS FRN 31/1/2039 | 335.904 | 0,01 |
| | Singapur | | | EUR 140.639 | Autonomia Spain '2021-SP E' FT RegS FRN 31/1/2039 | 133.088 | 0,00 |
| USD 200.000 | ABJA Investment Co Pte Ltd RegS 5,95% 31/7/2024 | 186.841 | 0,01 | EUR 574.283 | Autonomia Spain '2022-SP B' FT RegS FRN 26/1/2040 | 578.384 | 0,02 |
| USD 300.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd RegS FRN 15/6/2032 | 275.175 | 0,01 | EUR 382.855 | Autonomia Spain '2022-SP C' FT RegS FRN 27/1/2040 | 385.894 | 0,01 |
| USD 2.825.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 4,75% 19/5/2033 | 2.643.814 | 0,09 | EUR 191.428 | Autonomia Spain '2022-SP D' FT RegS FRN 28/1/2040 | 192.701 | 0,01 |
| USD 10.275.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,30% 19/5/2053 | 9.812.188 | 0,34 | EUR 382.855 | Autonomia Spain '2022-SP E' FT RegS FRN 29/1/2040 | 385.886 | 0,01 |
| USD 3.226.000 | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5,34% 19/5/2063 | 3.004.067 | 0,10 | EUR 300.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 7/2/2029 | 290.472 | 0,01 |
| | | 15.922.085 | 0,55 | EUR 200.000 | Banco de Sabadell SA RegS FRN 15/4/2031 | 171.794 | 0,01 |
| | Slowakei | | | EUR 13.200.000 | Banco Santander SA RegS FRN 31/12/2099 | 8.761.500 | 0,30 |
| EUR 11.143.884 | Slovakia Government Bond RegS 4,00% 23/2/2043 | 11.048.910 | 0,38 | EUR 400.000 | Bankinter SA RegS FRN 3/5/2030 | 400.684 | 0,01 |
| | | 11.048.910 | 0,38 | EUR 3.023.648 | BBVA Consumer Auto '2020-1 A' FTA RegS FRN 20/1/2036 | 3.028.599 | 0,11 |
| | Südafrika | | | EUR 2.800.000 | CaixaBank SA RegS FRN 14/11/2030 | 2.892.708 | 0,10 |
| ZAR 60.000.000 | Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035 | 2.232.246 | 0,08 | USD 200.000 | Cellnex Finance Co SA 3,875% 7/7/2041 | 138.564 | 0,01 |
| ZAR 487.266.903 | Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048 | 16.247.191 | 0,56 | EUR 1.000.000 | Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033 | 787.680 | 0,03 |
| ZAR 192.872.345 | Republic of South Africa Government Bond 11,625% 31/3/2053 | 8.367.247 | 0,29 | EUR 800.000 | Cellnex Telecom SA RegS 1,75% 23/10/2030 [*] | 655.952 | 0,02 |
| | | 26.846.684 | 0,93 | EUR 1.000.000 | Cellnex Telecom SA RegS 0,75% 20/11/2031 | 793.390 | 0,03 |
| | Südkorea | | | EUR 1.716.697 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 A' RegS FRN 21/3/2033 | 1.716.521 | 0,06 |
| USD 350.000 | GS Caltex Corp RegS 4,50% 5/1/2026 | 320.634 | 0,01 | EUR 429.174 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 B' RegS FRN 21/3/2033 | 422.448 | 0,01 |
| USD 400.000 | Hana Bank RegS 3,25% 30/3/2027 | 356.081 | 0,01 | EUR 128.752 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 C' RegS FRN 21/3/2033 | 125.971 | 0,00 |
| USD 200.000 | Korean Air Lines Co Ltd RegS 4,75% 23/9/2025 | 185.131 | 0,00 | EUR 214.587 | FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 D' RegS 3,50% 21/3/2033 | 198.287 | 0,01 |
| USD 278.000 | KT Corp RegS 4,00% 8/8/2025 | 254.242 | 0,01 | EUR 300.000 | International Consolidated Airlines Group SA RegS 0,50% 4/7/2023 | 298.989 | 0,01 |
| USD 200.000 | Shinhan Bank Co Ltd RegS 4,50% 12/4/2028 | 185.712 | 0,01 | EUR 300.000 | International Consolidated Airlines Group SA RegS 3,75% 25/3/2029 | 259.521 | 0,01 |
| USD 200.000 | SK Hynix Inc RegS 6,25% 17/1/2026 | 187.922 | 0,01 | EUR 130.000 | Kaixo Bondco Telecom SA RegS 5,125% 30/9/2029 | 113.864 | 0,00 |
| USD 200.000 | SK Hynix Inc RegS 6,50% 17/1/2033 | 188.535 | 0,01 | EUR 197.000 | Lorca Telecom Bondco SA RegS 4,00% 18/9/2027 | 180.326 | 0,01 |
| USD 400.000 | Tongyang Life Insurance Co Ltd RegS FRN 31/12/2099 | 326.579 | 0,01 | | | 32.847.630 | 1,14 |
| | | 2.004.836 | 0,07 | | | | |
| | Spanien | | | | | | |
| EUR 187.298 | Autonomia Spain '2019-SP B' RegS FRN 27/12/2035 | 186.185 | 0,01 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|--------------------------------|--|------------------------|--------------------|-----------------------|--|------------------------|--------------------|
| Supranationale Anleihen | | | | Großbritannien | | | |
| EUR 40.420.000 | European Investment Bank RegS 15/11/2027 (Zero Coupon) | 35.675.500 | 1,24 | EUR 600.000 | Agps Bondco Plc RegS 6,00% 5/8/2025 | 287.298 | 0,01 |
| EUR 13.234.000 | European Investment Bank RegS 0,05% 15/11/2029 | 11.075.402 | 0,38 | EUR 200.000 | Agps Bondco Plc RegS 5,50% 13/11/2026 | 80.246 | 0,00 |
| EUR 7.450.000 | European Investment Bank RegS 2,25% 15/3/2030 | 7.164.665 | 0,25 | EUR 300.000 | Agps Bondco Plc RegS 5,00% 27/4/2027 | 113.385 | 0,00 |
| EUR 18.228.000 | European Investment Bank RegS 2,75% 30/7/2030 [^] | 18.089.285 | 0,63 | EUR 300.000 | Agps Bondco Plc RegS 5,00% 14/1/2029 | 102.453 | 0,00 |
| EUR 18.120.000 | European Stability Mechanism RegS 1,85% 1/12/2055 [^] | 12.868.462 | 0,45 | GBP 493.092 | Albion '4 A' Plc RegS FRN 17/8/2062 | 572.583 | 0,02 |
| EUR 20.908.000 | European Union RegS 3,375% 4/11/2042 | 20.940.826 | 0,73 | EUR 1.998.000 | Anglo American Capital Plc RegS 5,00% 15/3/2031 | 2.057.860 | 0,07 |
| EUR 26.816.757 | European Union RegS 2,50% 4/10/2052 | 22.474.856 | 0,78 | EUR 6.875.000 | Anglo American Capital Plc RegS 4,75% 21/9/2032 | 6.897.687 | 0,24 |
| EUR 7.969.551 | European Union RegS 3,00% 4/3/2053 | 7.387.375 | 0,26 | GBP 306.000 | Atlas Funding '2021-1 B' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 353.646 | 0,01 |
| EUR 7.039.000 | International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061 | 2.479.417 | 0,08 | GBP 100.000 | Atlas Funding '2021-1 C' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 115.188 | 0,00 |
| | | 138.155.788 | 4,80 | GBP 100.000 | Atlas Funding '2021-1 D' Plc RegS FRN 25/7/2058 | 114.904 | 0,00 |
| Schweden | | | | GBP 1.946.000 | Atlas Funding '2023-1 A' Plc RegS FRN 20/1/2063 | 2.258.677 | 0,08 |
| EUR 300.000 | Heimstaden Bostad AB RegS FRN 31/12/2099 | 190.662 | 0,01 | GBP 330.000 | Atlas Funding '2023-1 C' Plc RegS FRN 20/1/2061 | 382.684 | 0,01 |
| EUR 6.800.000 | Kommuninvest I Sverige AB RegS 0,875% 1/9/2029 | 6.015.824 | 0,21 | GBP 296.000 | Atlas Funding '2023-1 D' Plc RegS FRN 20/1/2061 | 343.925 | 0,01 |
| EUR 100.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB RegS 1,125% 4/9/2026 | 71.846 | 0,00 | GBP 470.672 | Azure Finance '2 C' Plc RegS FRN 20/7/2030 | 547.674 | 0,02 |
| EUR 250.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB RegS FRN 31/12/2099 | 53.773 | 0,00 | GBP 5.210.000 | Barclays Plc RegS FRN 31/1/2031 | 5.946.729 | 0,21 |
| EUR 4.500.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 3/11/2031 | 3.875.535 | 0,14 | EUR 11.800.000 | Barclays Plc RegS FRN 29/1/2034 | 11.958.474 | 0,42 |
| GBP 3.085.000 | Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 23/8/2032 | 3.248.774 | 0,11 | GBP 1.198.000 | Barley Hill '2 B' Plc RegS FRN 27/8/2058 | 1.362.243 | 0,05 |
| EUR 250.000 | Swedbank AB RegS 1,30% 17/2/2027 | 225.163 | 0,01 | GBP 286.000 | Barley Hill '2 C' Plc RegS FRN 27/8/2058 | 319.408 | 0,01 |
| EUR 15.150.000 | Swedbank AB RegS 4,25% 11/7/2028 | 15.184.087 | 0,53 | GBP 215.000 | Bellis Acquisition Co Plc RegS 3,25% 16/2/2026 | 212.757 | 0,01 |
| EUR 9.050.000 | Telia Co AB RegS 3,625% 14/2/2024 | 9.032.805 | 0,31 | GBP 300.000 | Bellis Acquisition Co Plc RegS 4,50% 16/2/2026 | 303.781 | 0,01 |
| | | 37.898.469 | 1,32 | GBP 2.153.636 | Brass '11X A1' Plc RegS FRN 16/11/2070 | 2.517.575 | 0,09 |
| Schweiz | | | | GBP 732.753 | Brass '8X A2' Plc RegS FRN 16/11/2066 | 851.597 | 0,03 |
| GBP 8.860.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 12/9/2025 | 9.550.582 | 0,33 | EUR 4.691.000 | Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030 | 3.783.901 | 0,13 |
| EUR 15.316.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028 | 13.085.225 | 0,45 | GBP 382.000 | Canada Square Funding '2021- 2 B' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 433.373 | 0,01 |
| EUR 21.708.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 1/3/2029 | 24.058.976 | 0,84 | GBP 102.000 | Canada Square Funding '2021- 2 C' Plc RegS FRN 17/6/2058 | 115.431 | 0,00 |
| GBP 5.130.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 15/11/2029 | 4.692.148 | 0,16 | GBP 317.000 | Canada Square Funding '6 C' Plc RegS FRN 17/1/2059 | 351.326 | 0,01 |
| EUR 24.623.000 | Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2032 | 21.274.272 | 0,74 | GBP 178.000 | Canada Square Funding '6 D' Plc RegS FRN 17/1/2059 | 191.032 | 0,01 |
| | | 72.661.203 | 2,52 | GBP 2.051.000 | Canary Wharf Finance 'II D2' Plc RegS FRN 22/10/2037 | 1.872.544 | 0,06 |
| Thailand | | | | GBP 300.000 | Canary Wharf Finance II Plc 'C2' RegS FRN 22/10/2037 | 286.940 | 0,01 |
| USD 398.000 | Bangkok Bank PCL RegS FRN 31/12/2099 | 351.245 | 0,01 | EUR 12.350.000 | Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031 | 9.864.686 | 0,34 |
| USD 475.000 | GC Treasury Center Co Ltd RegS 4,40% 30/3/2032 [^] | 407.461 | 0,01 | EUR 2.375.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 2.175.310 | 0,08 |
| USD 200.000 | Krung Thai Bank PCL RegS FRN 31/12/2099 | 171.527 | 0,01 | GBP 1.625.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050 | 1.584.289 | 0,05 |
| USD 200.000 | Minor International PCL RegS FRN 31/12/2099 | 168.361 | 0,01 | GBP 1.971.945 | CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 2.282.181 | 0,08 |
| USD 295.000 | Muang Thai Life Assurance PCL RegS FRN 27/1/2037 | 241.762 | 0,01 | | | | |
| | | 1.340.356 | 0,05 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------|--|------------------------|--------------------|----------------|---|------------------------|--------------------|
| | Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | |
| GBP 220.000 | CMF '2020-1 B' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 253.043 | 0,01 | GBP 500.000 | Greene King Finance Plc FRN 15/12/2034 | 437.198 | 0,02 |
| GBP 100.000 | CMF '2020-1 C' Plc RegS FRN 16/1/2057 | 114.666 | 0,00 | GBP 1.549.550 | Greene King Finance Plc RegS 3,593% 15/3/2035 | 1.482.021 | 0,05 |
| GBP 3.063.000 | Delamare Cards MTN Issuer '2023-1 A1' Plc RegS FRN 19/4/2031 | 3.556.693 | 0,12 | GBP 792.925 | Greene King Finance Plc RegS 4,064% 15/3/2035 | 773.345 | 0,03 |
| GBP 3.404.000 | Dignity Finance Plc RegS (traded in International) 4,696% 31/12/2049 | 2.508.949 | 0,09 | GBP 741.000 | Harben Finance '2017-1RX C' RegS FRN 28/9/2055 | 814.323 | 0,03 |
| GBP 4.100.000 | Dignity Finance Plc RegS (traded in Ireland) 4,696% 31/12/2049 | 3.021.942 | 0,10 | GBP 441.000 | Harben Finance '2017-1RX D' RegS FRN 28/9/2055 | 461.221 | 0,02 |
| GBP 1.600.000 | Dowson '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 1.851.721 | 0,06 | USD 200.000 | Harbour Energy Plc 5,50% 15/10/2026* | 172.929 | 0,01 |
| GBP 1.300.000 | Dowson '2021-2 C' Plc RegS FRN 20/10/2028 | 1.494.047 | 0,05 | GBP 369.000 | Heathrow Finance Plc RegS 4,75% 1/3/2024 | 420.709 | 0,01 |
| GBP 832.518 | Dowson '2022-1 A' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 966.823 | 0,03 | GBP 110.000 | Heathrow Finance Plc RegS 5,75% 3/3/2025 | 125.070 | 0,00 |
| GBP 1.868.000 | Dowson '2022-1 B' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 2.167.370 | 0,08 | GBP 120.000 | Heathrow Finance Plc RegS 3,875% 1/3/2027 | 121.422 | 0,00 |
| GBP 407.000 | Dowson '2022-1 C' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 469.144 | 0,02 | GBP 2.868.000 | Holmes Master Issuer '2023-1X A1' Plc RegS FRN 15/10/2027 | 3.338.269 | 0,12 |
| GBP 213.000 | Dowson '2022-1 D' Plc RegS FRN 20/1/2029 | 242.263 | 0,01 | GBP 2.933.397 | Hops Hill '1 A' Plc RegS FRN 27/5/2054 | 3.401.879 | 0,12 |
| GBP 284.000 | Dowson '2022-2 C' Plc RegS FRN 20/8/2029 | 332.220 | 0,01 | GBP 345.980 | Hops Hill '1 B' Plc RegS FRN 27/5/2054 | 399.609 | 0,01 |
| GBP 279.000 | Dowson '2022-2 D' Plc RegS FRN 20/8/2029 | 326.275 | 0,01 | GBP 199.992 | Hops Hill '1 C' Plc RegS FRN 27/5/2054 | 229.601 | 0,01 |
| GBP 2.466.140 | E-Carat '12 A' Plc RegS FRN 18/8/2029 | 2.857.862 | 0,10 | GBP 99.998 | Hops Hill '1 D' Plc RegS FRN 27/5/2054 | 113.689 | 0,00 |
| GBP 606.667 | Economic Master Issuer '2020-1X A1' Plc RegS FRN 25/6/2072 | 703.580 | 0,02 | GBP 6.282.060 | Hops Hill '2 A' Plc RegS FRN 27/11/2054 | 7.314.711 | 0,25 |
| GBP 4.444.000 | Economic Master Issuer '2021-1X A' Plc RegS FRN 25/6/2073 | 5.131.300 | 0,18 | GBP 824.000 | Hops Hill '2 B' Plc RegS FRN 27/11/2054 | 946.830 | 0,03 |
| GBP 2.143.200 | Economic Master Issuer '2023-1 A' Plc RegS FRN 25/6/2074 | 2.492.119 | 0,09 | GBP 406.000 | Hops Hill '2 C' Plc RegS FRN 27/11/2054 | 465.984 | 0,02 |
| EUR 230.000 | eG Global Finance Plc RegS 3,625% 7/2/2024* | 229.009 | 0,01 | GBP 4.415.000 | Hops Hill '3 B' Plc RegS FRN 21/12/2055 | 5.015.996 | 0,17 |
| GBP 1.990.497 | Elvet Mortgages '2021-1 A' Plc RegS FRN 22/10/2063 | 2.300.717 | 0,08 | GBP 890.000 | Hops Hill '3 C' Plc RegS FRN 21/12/2055 | 1.004.414 | 0,03 |
| GBP 686.266 | Finsbury Square '2020-2X A' Plc RegS FRN 16/6/2070 | 796.038 | 0,03 | USD 230.000 | HSBC Bank Plc FRN 29/6/2049 | 215.083 | 0,01 |
| GBP 6.218.415 | Finsbury Square '2021-1GRX AGRN' RegS FRN 16/12/2067 | 7.129.233 | 0,25 | USD 980.000 | HSBC Bank Plc FRN 29/6/2049 | 916.386 | 0,03 |
| GBP 3.573.000 | Finsbury Square '2021-1GRX B' RegS FRN 16/12/2067 | 4.059.569 | 0,14 | USD 670.000 | HSBC Bank Plc FRN 30/9/2049 | 623.095 | 0,02 |
| GBP 1.045.000 | Finsbury Square '2021-1GRX C' RegS FRN 16/12/2067 | 1.176.105 | 0,04 | USD 13.325.000 | HSBC Holdings Plc FRN 31/12/2099* | 9.525.988 | 0,33 |
| GBP 371.000 | Finsbury Square '2021-2X C' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 409.646 | 0,01 | EUR 6.885.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 10/3/2032 | 6.971.062 | 0,24 |
| GBP 201.000 | Finsbury Square '2021-2X D' Plc RegS FRN 16/12/2071 | 218.147 | 0,01 | EUR 2.673.000 | HSBC Holdings Plc RegS FRN 16/11/2032 | 2.759.338 | 0,10 |
| GBP 953.642 | Friary '7 A' Plc FRN 21/10/2070 | 1.110.860 | 0,04 | EUR 311.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc RegS 2,50% 15/1/2026 | 282.121 | 0,01 |
| GBP 3.450.569 | Gemgarto '2021-1X A' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 3.975.862 | 0,14 | GBP 408.000 | Iron Mountain UK Plc RegS 3,875% 15/11/2025 | 448.434 | 0,02 |
| GBP 669.000 | Gemgarto '2021-1X B' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 768.315 | 0,03 | GBP 2.889.395 | Jupiter Mortgage '1X A' Plc RegS FRN 20/7/2060 | 3.345.141 | 0,12 |
| GBP 218.000 | Gemgarto '2021-1X C' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 246.705 | 0,01 | GBP 785.000 | Lanark Master Issuer '2020-1X 2A' Plc RegS FRN 22/12/2069 | 910.778 | 0,03 |
| GBP 62.832 | Gemgarto '2021-1X X' Plc RegS FRN 16/12/2067 | 72.875 | 0,00 | GBP 3.386.793 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 A1' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 3.928.999 | 0,14 |
| GBP 1.190.788 | Gosforth Funding '2018-1X A2' Plc RegS FRN 25/8/2060 | 1.381.936 | 0,05 | GBP 630.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 B' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 730.545 | 0,03 |
| | | | | GBP 370.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 C' Plc RegS FRN 12/6/2057 | 425.057 | 0,01 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|-----------------------------------|---|------------------------|--------------------|-----------------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| GBP 266.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 B' Plc RegS FRN 20/7/2058 | 299.584 | 0,01 | GBP 3.778.964 | Oat Hill '2 A' Plc RegS FRN 27/5/2046 | 4.385.580 | 0,15 |
| GBP 159.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 C' Plc RegS FRN 20/7/2058 | 176.448 | 0,01 | GBP 31.472 | Orbita Funding '2020-1 A' Plc RegS FRN 17/3/2027 | 36.494 | 0,00 |
| GBP 103.000 | Lanebrook Mortgage Transaction '2021-1 D' Plc RegS FRN 20/7/2058 | 112.368 | 0,00 | EUR 557.279 | Paragon Mortgages '12X A2B' Plc RegS FRN 15/11/2038 | 550.467 | 0,02 |
| GBP 10.517.000 | LCR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028 | 12.140.614 | 0,42 | GBP 1.648.312 | Parkmore Point RMBS '2022- 1X A' Plc RegS FRN 25/7/2045 | 1.908.982 | 0,07 |
| GBP 9.049.000 | Lloyds Bank Plc RegS 7,625% 22/4/2025 | 10.741.201 | 0,37 | GBP 4.402.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 A' RegS FRN 15/10/2025 | 5.103.985 | 0,18 |
| GBP 2.562.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN 15/12/2031 | 2.511.625 | 0,09 | GBP 486.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 B' RegS FRN 15/10/2025 | 561.784 | 0,02 |
| USD 8.020.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN 31/12/2099 | 6.922.179 | 0,24 | GBP 115.000 | PCL Funding V Plc '2021-1 C' RegS FRN 15/10/2025 | 132.652 | 0,00 |
| EUR 200.000 | Lloyds Banking Group Plc RegS FRN (Perpetual) | 184.170 | 0,01 | GBP 436.000 | PCL Funding VI '2022-1 B' Plc RegS FRN 15/7/2026 | 508.789 | 0,02 |
| GBP 2.489.725 | London Wall Mortgage Capital '2021-FL1 A' Plc RegS FRN 15/5/2051 | 2.855.560 | 0,10 | GBP 2.684.000 | PCL Funding VIII '2023-1 A' Plc RegS FRN 15/5/2028 | 3.114.894 | 0,11 |
| GBP 116.907 | Metrocentre Finance Plc RegS 8,75% 6/12/2023 | 62.213 | 0,00 | GBP 497.000 | PCL Funding VIII '2023-1 B' Plc RegS FRN 15/5/2028 | 576.415 | 0,02 |
| GBP 2.080.000 | Mitchells & Butlers Finance Plc RegS 6,469% 15/9/2030 | 2.149.065 | 0,07 | GBP 214.000 | PCL Funding VIII '2023-1 C' Plc RegS FRN 15/5/2028 | 248.226 | 0,01 |
| GBP 955.000 | Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/9/2034 | 886.001 | 0,03 | GBP 803.000 | Pinewood Finance Co Ltd RegS 3,25% 30/9/2025 | 870.421 | 0,03 |
| GBP 1.165.000 | Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/6/2036 | 1.050.020 | 0,04 | GBP 1.815.000 | Polaris '2022-1 B' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 2.068.939 | 0,07 |
| GBP 4.091.642 | Mortimer BTL '2021-1 A' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 4.686.872 | 0,16 | GBP 421.000 | Polaris '2022-1 C' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 468.851 | 0,02 |
| GBP 334.000 | Mortimer BTL '2021-1 B' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 373.786 | 0,01 | GBP 307.000 | Polaris '2022-1 D' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 337.023 | 0,01 |
| GBP 110.000 | Mortimer BTL '2021-1 C' Plc RegS FRN 23/6/2053 | 120.961 | 0,00 | GBP 538.000 | Polaris '2022-1 E' Plc RegS FRN 23/10/2059 | 594.538 | 0,02 |
| EUR 3.178.000 | National Grid Plc RegS 2,949% 30/3/2030 | 2.976.547 | 0,10 | GBP 1.973.000 | Polaris '2023-1 B' Plc RegS FRN 23/2/2061 | 2.287.976 | 0,08 |
| EUR 4.186.000 | National Grid Plc RegS 4,275% 16/1/2035 | 4.161.554 | 0,14 | GBP 503.000 | Polaris '2023-1 C' Plc RegS FRN 23/2/2061 | 583.374 | 0,02 |
| EUR 6.598.000 | Nationwide Building Society RegS 0,25% 14/9/2028 ^a | 5.432.001 | 0,19 | GBP 380.000 | Polaris '2023-1 C' Plc RegS FRN 23/2/2061 | 440.775 | 0,02 |
| GBP 15.460.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 14/8/2030 | 16.707.489 | 0,58 | GBP 2.993.309 | Precise Mortgage Funding '2019-1B A2' Plc RegS FRN 12/12/2055 | 3.474.562 | 0,12 |
| GBP 3.873.000 | NatWest Group Plc RegS FRN 28/11/2031 | 3.776.059 | 0,13 | GBP 115.000 | Precise Mortgage Funding '2020-1B B' Plc RegS FRN 16/10/2056 | 132.572 | 0,00 |
| GBP 3.350.000 | NatWest Markets Plc RegS 6,375% 8/11/2027 | 3.936.538 | 0,14 | GBP 100.000 | Precise Mortgage Funding '2020-1B C' Plc RegS FRN 16/10/2056 | 114.466 | 0,00 |
| USD 1.777.000 | Neptune Energy Bondco Plc 6,625% 15/5/2025 | 1.641.531 | 0,06 | GBP 100.000 | Precise Mortgage Funding '2020-1B D' Plc RegS FRN 16/10/2056 | 113.009 | 0,00 |
| GBP 677.000 | Newday Funding Master Issuer Plc - Series '2021-3X B' RegS FRN 15/11/2029 | 773.779 | 0,03 | GBP 543.000 | Premier Foods Finance Plc RegS 3,50% 15/10/2026 | 572.091 | 0,02 |
| GBP 3.121.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029 | 3.612.372 | 0,13 | GBP 122.200 | Premiertel Plc 6,175% 8/5/2032 | 129.631 | 0,00 |
| GBP 775.000 | Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X B' RegS FRN 15/3/2029 | 894.012 | 0,03 | GBP 5.200.000 | Prs Finance Plc RegS 2,00% 23/1/2029 | 5.201.208 | 0,18 |
| GBP 343.000 | Newday Funding Master Issuer Series '2022-2X C' Plc RegS FRN 15/7/2030 | 401.214 | 0,01 | GBP 3.501.298 | Residential Mortgage S ecurities '32X A' Plc RegS FRN 20/6/2070 | 4.066.685 | 0,14 |
| EUR 260.601 | Newgate Funding '2006-1 BB' Plc RegS FRN 1/12/2050 | 242.318 | 0,01 | GBP 525.000 | Residential Mortgage Securities '32X C' Plc RegS FRN 20/6/2070 | 605.146 | 0,02 |
| GBP 9.683.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 18/6/2073 | 10.824.017 | 0,38 | GBP 3.240.594 | RMAC NO 2 '2018-2 A' Plc RegS FRN 12/6/2046 | 3.756.007 | 0,13 |
| EUR 1.536.000 | NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082 | 1.315.031 | 0,05 | GBP 410.000 | RMAC NO 2 '2018-2 B' Plc RegS FRN 12/6/2046 | 475.265 | 0,02 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|----------------|---|------------------------|--------------------|---------------|---|------------------------|--------------------|
| | Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | |
| GBP 420.000 | RMAC NO 2 '2018-2 C' Plc RegS FRN 12/6/2046 | 486.864 | 0,02 | GBP 382.999 | Tower Bridge Funding '2021-1 B' Plc RegS FRN 21/7/2064 | 442.078 | 0,02 |
| EUR 1.772.121 | RMAC Securities '2006-NS1X M1C' Plc RegS FRN 12/6/2044 | 1.676.221 | 0,06 | GBP 364.999 | Tower Bridge Funding '2021-1 C' Plc RegS FRN 21/7/2064 | 420.118 | 0,01 |
| GBP 3.345.000 | Sage AR Funding '1X A' Plc RegS FRN 17/11/2030 | 3.772.555 | 0,13 | GBP 253.000 | Tower Bridge Funding '2021-1 D' Plc RegS FRN 21/7/2064 | 289.671 | 0,01 |
| GBP 1.085.000 | Sage AR Funding '1X B' Plc RegS FRN 17/11/2030 | 1.210.727 | 0,04 | GBP 2.097.589 | Tower Bridge Funding '2021-2 A' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 2.417.971 | 0,08 |
| GBP 535.000 | Sage AR Funding '1X C' Plc RegS FRN 17/11/2030 | 582.984 | 0,02 | GBP 252.999 | Tower Bridge Funding '2021-2 B' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 288.760 | 0,01 |
| EUR 13.400.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 28/2/2025 | 12.989.558 | 0,45 | GBP 139.999 | Tower Bridge Funding '2021-2 C' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 157.920 | 0,01 |
| EUR 8.175.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 13/9/2029 | 6.587.905 | 0,23 | GBP 168.999 | Tower Bridge Funding '2021-2 D' Plc RegS FRN 20/11/2063 | 183.635 | 0,01 |
| GBP 404.000 | Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 31/12/2099 | 437.714 | 0,02 | GBP 3.962.535 | Tower Bridge Funding '2022-1 A' Plc RegS FRN 20/12/2063 | 4.570.027 | 0,16 |
| GBP 123.000 | Satus '2021-1 D' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 139.173 | 0,00 | GBP 378.000 | Tower Bridge Funding '2023-1X B' Plc RegS FRN 20/12/2063 | 430.365 | 0,01 |
| GBP 247.000 | Satus '2021-1 E' Plc RegS FRN 17/8/2028 | 273.035 | 0,01 | GBP 264.000 | Tower Bridge Funding '2022-1X C' Plc RegS FRN 20/12/2063 | 293.413 | 0,01 |
| GBP 500.000 | Sherwood Financing Plc RegS 6,00% 15/11/2026 | 475.097 | 0,02 | GBP 333.000 | Tower Bridge Funding '2023-1 B' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 389.092 | 0,01 |
| GBP 5.005.551 | Silk Road Finance Number Six '2019-2 A' Plc RegS FRN 21/9/2067 | 5.804.961 | 0,20 | GBP 285.000 | Tower Bridge Funding '2023-1 D' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 331.943 | 0,01 |
| GBP 1.100.000 | Silverstone Master Issuer '2018-1X 2A' Plc RegS FRN 21/1/2070 | 1.275.828 | 0,04 | GBP 2.693.000 | Tower Bridge Funding '2023-1X A' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 3.141.444 | 0,11 |
| USD 5.195.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025* | 4.667.546 | 0,16 | GBP 253.000 | Tower Bridge Funding '2023-1X C' Plc RegS FRN 20/10/2064 | 294.029 | 0,01 |
| EUR 909.000 | Standard Chartered Plc RegS FRN 10/5/2031 | 914.309 | 0,03 | GBP 176.000 | Tower Bridge Funding '2023-2X C' Plc RegS FRN 20/3/2065 | 204.123 | 0,01 |
| GBP 754.266 | Stanlington '2 A' Plc RegS FRN 12/6/2045 | 871.080 | 0,03 | GBP 285.000 | Tower Bridge Funding '2023-2X D' Plc RegS FRN 20/3/2065 | 330.581 | 0,01 |
| GBP 2.261.000 | Stanlington '2 B' Plc RegS FRN 12/6/2045 | 2.586.981 | 0,09 | GBP 922.000 | Travis Perkins Plc RegS 4,50% 7/9/2023 | 1.056.161 | 0,04 |
| GBP 280.000 | Stanlington '2 C' Plc RegS FRN 12/6/2045 | 316.929 | 0,01 | GBP 1.407.695 | Turbo Finance 9 Plc 'A' RegS FRN 20/8/2028 | 1.633.680 | 0,06 |
| GBP 259.000 | Stanlington '2 D' Plc RegS FRN 12/6/2045 | 287.991 | 0,01 | GBP 1.594.000 | Turbo Finance 9 Plc 'B' RegS FRN 20/8/2028 | 1.850.001 | 0,06 |
| GBP 450.000 | Stanlington '2 E' Plc RegS FRN 12/6/2045 | 495.180 | 0,02 | GBP 887.493 | Twin Bridges '2018-1 A' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 1.029.681 | 0,04 |
| GBP 950.000 | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc RegS 8,00% 13/7/2025 | 1.017.240 | 0,04 | GBP 1.685.000 | Twin Bridges '2018-1 B' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 1.954.019 | 0,07 |
| GBP 921.000 | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc RegS 8,25% 31/7/2025 | 995.861 | 0,03 | GBP 3.483.000 | Twin Bridges '2018-1 C' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 4.041.097 | 0,14 |
| GBP 232.500 | Telereal Securitisation Plc FRN 10/9/2031 | 222.548 | 0,01 | GBP 2.040.000 | Twin Bridges '2018-1 D' Plc RegS FRN 12/9/2050 | 2.366.205 | 0,08 |
| EUR 8.775.000 | Thames Water Utilities Finance Plc RegS 4,375% 18/1/2031 | 8.803.431 | 0,31 | GBP 1.145.000 | Twin Bridges '2020-1 B' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 1.330.315 | 0,05 |
| GBP 156.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 B' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 175.329 | 0,01 | GBP 390.000 | Twin Bridges '2020-1 C' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 451.515 | 0,02 |
| GBP 107.000 | Together Asset Backed Securitisation '2021-1ST1 C' Plc RegS FRN 12/7/2063 | 119.217 | 0,00 | GBP 225.000 | Twin Bridges '2020-1 D' Plc RegS FRN 12/12/2054 | 259.824 | 0,01 |
| GBP 2.599.381 | Tower Bridge Funding '2020-1 A' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 3.016.404 | 0,10 | GBP 3.167.162 | Twin Bridges '2021-1 A' Plc RegS FRN 12/3/2055 | 3.655.913 | 0,13 |
| GBP 695.000 | Tower Bridge Funding '2020-1 B' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 806.474 | 0,03 | GBP 1.310.000 | Twin Bridges '2021-1 B' Plc RegS FRN 12/3/2055 | 1.501.652 | 0,05 |
| GBP 145.000 | Tower Bridge Funding '2020-1 C' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 168.278 | 0,01 | GBP 436.000 | Twin Bridges '2021-1 C' Plc RegS FRN 12/3/2055 | 489.880 | 0,02 |
| GBP 115.000 | Tower Bridge Funding '2020-1 D' Plc RegS FRN 20/9/2063 | 133.428 | 0,00 | GBP 220.000 | Twin Bridges '2021-1 D' Plc RegS FRN 12/3/2055 | 243.509 | 0,01 |
| GBP 3.112.877 | Tower Bridge Funding '2021-1 A' Plc RegS FRN 21/7/2064 | 3.605.947 | 0,13 | GBP 986.000 | Twin Bridges '2021-2 B' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 1.104.314 | 0,04 |
| | | | | GBP 435.000 | Twin Bridges '2021-2 C' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 479.872 | 0,02 |
| | | | | GBP 187.000 | Twin Bridges '2021-2 D' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 200.236 | 0,01 |
| | | | | GBP 39.307 | Twin Bridges '2021-2 X1' Plc RegS FRN 12/9/2055 | 45.490 | 0,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|--|------------------------|--------------------|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| GBP 8.275.725 | Twin Bridges '2022-1 A' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 9.478.559 | 0,33 | EUR 876.000 | American Tower Corp 0,95% 5/10/2030 | 689.552 | 0,02 |
| GBP 2.097.000 | Twin Bridges '2022-1 B' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 2.365.742 | 0,08 | EUR 4.800.000 | American Tower Corp 4,625% 16/5/2031 | 4.815.528 | 0,17 |
| GBP 830.000 | Twin Bridges '2022-1 C' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 905.105 | 0,03 | EUR 520.000 | American Tower Corp 1,00% 15/1/2032 | 389.636 | 0,01 |
| GBP 365.000 | Twin Bridges '2022-1 D' Plc RegS FRN 1/12/2055 | 391.913 | 0,01 | USD 8.400.000 | Bank of America Corp FRN 25/4/2034 | 7.811.262 | 0,27 |
| GBP 681.000 | Twin Bridges '2022-2 B' Plc RegS FRN 12/6/2055 | 783.820 | 0,03 | EUR 15.800.000 | Bank of America Corp RegS FRN 27/4/2033 | 14.083.535 | 0,49 |
| GBP 1.727.000 | Twin Bridges '2023-1 A' RegS FRN 14/6/2055 | 1.996.007 | 0,07 | EUR 8.768.000 | Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025 | 8.239.114 | 0,29 |
| GBP 649.000 | Twin Bridges '2023-1 C' RegS FRN 14/6/2055 | 751.302 | 0,03 | EUR 548.000 | Boxer Parent Co Inc RegS 6,50% 2/10/2025 | 537.450 | 0,02 |
| GBP 626.000 | Twin Bridges '2023-1 D' RegS FRN 14/6/2055 | 724.476 | 0,02 | USD 14.644.000 | Capital One Financial Corp FRN 1/2/2029 | 13.327.362 | 0,46 |
| GBP 169.165 | Unique Pub Finance Co Plc RegS 7,395% 28/3/2024 | 195.196 | 0,01 | USD 1.235.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6,484% 23/10/2045 | 1.045.635 | 0,04 |
| GBP 760.117 | Unique Pub Finance Co Plc RegS 5,659% 30/6/2027 | 877.473 | 0,03 | USD 3.435.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,80% 1/3/2050 | 2.351.234 | 0,08 |
| GBP 171.000 | Unique Pub Finance Co Plc RegS 6,464% 30/3/2032 | 195.875 | 0,01 | USD 5.240.000 | Citigroup Inc FRN 25/5/2034 | 4.979.979 | 0,17 |
| GBP 5.280.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,50% 7/9/2034 | 6.267.872 | 0,22 | USD 425.000 | Cloud Software Group Inc '144A' 9,00% 30/9/2029 | 338.947 | 0,01 |
| GBP 3.440.000 | United Kingdom Gilt RegS 4,00% 22/10/2063 | 3.676.939 | 0,13 | EUR 951.000 | Comcast Corp 14/9/2026 (Zero Coupon) | 848.768 | 0,03 |
| GBP 21.765.190 | United Kingdom Inflation- Linked Gilt RegS 0,125% 10/8/2028 | 24.699.104 | 0,86 | USD 4.414.000 | Delta Air Lines '2019-1 AA' Pass Through Trust 3,204% 25/4/2024 | 4.033.556 | 0,14 |
| GBP 6.166.000 | United Kingdom Inflation- Linked Gilt RegS 0,625% 22/3/2045 | 6.458.737 | 0,22 | EUR 5.145.000 | Eli Lilly & Co 1,375% 14/9/2061 | 2.740.896 | 0,10 |
| GBP 6.401.920 | United Kingdom Inflation- Linked Gilt RegS 0,125% 10/8/2048 | 5.796.132 | 0,20 | EUR 142.000 | Emerald Debt Merger Sub LLC RegS 6,375% 15/12/2030 | 140.975 | 0,00 |
| GBP 1.248.210 | United Kingdom Inflation- Linked Gilt RegS 0,125% 22/3/2051 | 1.106.740 | 0,04 | USD 5.500.000 | FirstEnergy Transmission LLC 4,35% 15/1/2025 | 5.041.105 | 0,18 |
| GBP 100.000 | Virgin Media Secured Finance Plc RegS 5,00% 15/4/2027 | 105.785 | 0,00 | GBP 311.000 | Ford Motor Credit Co LLC 2,748% 14/6/2024 | 344.794 | 0,01 |
| GBP 274.000 | Virgin Media Secured Finance Plc RegS 5,25% 15/5/2029 | 263.924 | 0,01 | GBP 5.164.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4,535% 6/3/2025 | 5.701.506 | 0,20 |
| GBP 418.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc RegS 4,00% 31/1/2029 | 380.831 | 0,01 | GBP 919.000 | Ford Motor Credit Co LLC 6,86% 5/6/2026 | 1.053.087 | 0,04 |
| EUR 1.000.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc RegS 3,25% 31/1/2031 | 798.330 | 0,03 | EUR 242.000 | Ford Motor Credit Co LLC 6,125% 15/5/2028 | 243.966 | 0,01 |
| USD 200.000 | Vodafone Group Plc FRN 4/6/2081 | 164.697 | 0,01 | EUR 9.000.000 | Global Payments Inc 4,875% 17/3/2031 | 9.117.153 | 0,32 |
| EUR 369.000 | Vodafone Group Plc RegS FRN 27/8/2080 | 331.248 | 0,01 | USD 1.000.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,30% 15/1/2029 | 898.308 | 0,03 |
| | | 488.027.140 | 16,95 | EUR 9.425.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024 | 9.431.974 | 0,33 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | EUR 12.500.000 | Goldman Sachs Group Inc RegS 0,875% 9/5/2029 | 10.351.750 | 0,36 |
| EUR 1.394.000 | Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032 | 1.097.078 | 0,04 | USD 1.015.000 | Gray Oak Pipeline LLC 2,00% 15/9/2023 | 939.472 | 0,03 |
| EUR 4.150.000 | Air Products and Chemicals Inc 4,00% 3/3/2035 | 4.213.370 | 0,15 | USD 7.010.000 | Gray Oak Pipeline LLC 2,60% 15/10/2025 | 6.062.195 | 0,21 |
| USD 2.286.940 | American Airlines '2015-2 B' Pass Through Trust 4,40% 22/9/2023 | 2.120.380 | 0,07 | USD 275.000 | Hanwha Energy USA Holdings Corp RegS 4,125% 5/7/2025 | 250.815 | 0,01 |
| USD 3.486.460 | American Airlines '2016-3 AA' Pass Through Trust 3,00% 15/10/2028 | 2.908.023 | 0,10 | EUR 5.025.000 | International Business Machines Corp 3,75% 6/2/2035 | 4.925.339 | 0,17 |
| USD 4.329.076 | American Airlines '2017-2 B' Pass Through Trust 3,70% 15/10/2025 | 3.788.870 | 0,13 | GBP 2.080.000 | JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2026 | 2.200.598 | 0,08 |
| EUR 1.562.000 | American Tower Corp 0,875% 21/5/2029 | 1.279.176 | 0,04 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in EUR | In % des NAV |
|---|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | BÖRSENGEHANDELTE FONDS (ETF) | | | |
| EUR 408.000 | Kronos International Inc RegS 3,75% 15/9/2025 | 379.434 | 0,01 | Irland | | | |
| USD 1.345.000 | Level 3 Financing Inc 3,75% 15/7/2029 | 689.337 | 0,02 | EUR 68.401 | iShares EUR Corp Bond ESG UCITS ETF ⁻ | 309.617 | 0,01 |
| EUR 360.000 | Liberty Mutual Group Inc RegS FRN 23/5/2059 | 331.834 | 0,01 | EUR 67.022 | iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF 'A' ⁻ | 321.022 | 0,01 |
| USD 2.895.000 | Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,10% 15/5/2028 | 2.609.780 | 0,09 | USD 5.174 | iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF 'D' ⁻ | 404.590 | 0,01 |
| EUR 8.050.000 | Morgan Stanley FRN 2/3/2029 | 8.191.930 | 0,28 | USD 300.744 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ^{-^} | 12.500.137 | 0,44 |
| EUR 12.100.000 | Morgan Stanley FRN 25/1/2034 | 12.698.829 | 0,44 | | | 13.535.366 | 0,47 |
| EUR 411.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3,325% 24/3/2025 [^] | 362.160 | 0,01 | Gesamt börsengehandelte Fonds | | | |
| EUR 5.550.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0,993% 15/10/2026 | 4.031.132 | 0,14 | Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| EUR 8.800.000 | National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023 | 8.753.712 | 0,30 | | | 2.678.035.663 | 93,01 |
| USD 21.500.000 | NextEra Energy Operating Partners LP 4,25% 15/7/2024 | 19.725.469 | 0,69 | Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| EUR 651.000 | Olympus Water US Holding Corp RegS 9,625% 15/11/2028 | 653.848 | 0,02 | STAMMAKTIE | | | |
| USD 465.000 | Oracle Corp 5,55% 6/2/2053 | 404.980 | 0,01 | Luxemburg | | | |
| USD 8.470.000 | Pacific Gas and Electric Co 4,95% 1/7/2050 | 6.127.275 | 0,21 | 16.484 | Adler Group S.A. [*] | 7.305 | 0,00 |
| USD 4.800.000 | Southern California Edison Co 3,65% 1/2/2050 | 3.321.224 | 0,12 | Gesamt Stammaktien | | | |
| GBP 4.200.000 | Time Warner Cable LLC 5,75% 2/6/2031 | 4.546.281 | 0,16 | Gesamt sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| USD 5.000.000 | Trans-Allegheny Interstate Line Co 3,85% 1/6/2025 | 4.548.673 | 0,16 | | | 7.305 | 0,00 |
| USD 1.685.428 | United Airlines '2014-1 A' Pass Through Trust 4,00% 11/4/2026 | 1.489.617 | 0,05 | Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| USD 1.513.850 | United Airlines '2020-1 B' Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026 | 1.342.864 | 0,05 | Irland | | | |
| USD 8.743.830 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,125% 15/1/2033 | 7.933.489 | 0,28 | 630.676 | BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Acc) ⁻ | 62.768.489 | 2,18 |
| EUR 6.975.000 | Verizon Communications Inc 4,75% 31/10/2034 | 7.463.641 | 0,26 | Luxemburg | | | |
| EUR 1.042.000 | Verizon Communications Inc 1,125% 19/9/2035 | 749.539 | 0,03 | 184.631 | Blackrock Strategic Funds - Blackrock ESG Euro Corporate Bond Fund ⁻ | 17.094.984 | 0,59 |
| USD 3.812.000 | VICI Properties LP 4,95% 15/2/2030 | 3.328.327 | 0,12 | Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | | 238.025.763 | 8,27 | Wertpapiervermögen zum Marktwert | | | |
| Gesamt Anleihen | | 2.664.500.297 | 92,54 | Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | | |
| | | | | Gesamt Netto-Fondsvermögen (EUR) | | | |

^{*} Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a).

[^] Ein Teil oder das gesamte Wertpapier repräsentiert ein verliehenes Wertpapier.

⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10.

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|---|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | USD 2.173.914 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.40 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (2.086) | 22.442 |
| CCCDs | USD 43.590.488 | Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.40 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (49.715) | (458.430) |
| CCCDs | EUR 90.499.699 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 and pays Fixed 5,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (798.531) | (2.448.632) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|--|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCCDs | EUR 247.325.790 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (1.356.389) | (840.111) |
| CCCDs | EUR 907.838.802 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (3.287.921) | (7.670.800) |
| CCCDs | EUR 159.218.431 | Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Subordinated Financials Series 39 Version 1 and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (4.474.302) | 5.106.664 |
| CCILs | EUR 33.470.000 | Fund receives Fixed 2,235% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2033 | (857.623) | (854.240) |
| CCILs | EUR 15.500.000 | Fund receives Fixed 2,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | (135.226) | (134.903) |
| CCILs | EUR 74.720.000 | Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2032 | (870.429) | (868.875) |
| CCILs | EUR 17.400.000 | Fund receives Fixed 2,520% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 3/1/2038 | (273.203) | (188.052) |
| CCILs | EUR 15.500.000 | Fund receives Fixed 2,528% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 85.456 | 78.648 |
| CCILs | EUR 24.400.000 | Fund receives Fixed 2,574% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2038 | (27.607) | (26.979) |
| CCILs | EUR 30.450.000 | Fund receives Fixed 2,601% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2043 | (274.602) | (252.692) |
| CCILs | EUR 75.000.000 | Fund receives Fixed 2,654% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2024 | (97.583) | (97.143) |
| CCILs | EUR 33.130.000 | Fund receives Fixed 2,690% and pays Floating EUR 12 Month FRCPXTOB | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2033 | (792.165) | (786.300) |
| CCILs | GBP 5.425.000 | Fund receives Fixed 3,458% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/4/2048 | (2.092) | 1.888 |
| CCILs | GBP 3.221.000 | Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2030 | (666.390) | (666.309) |
| CCILs | GBP 42.847.000 | Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI | Bank of America Merrill Lynch | 15/9/2028 | (6.621.886) | (6.621.886) |
| CCILs | EUR 33.670.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,225% | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2028 | 448.228 | 445.924 |
| CCILs | EUR 15.500.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,338% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2028 | 61.101 | 61.316 |
| CCILs | EUR 30.135.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,435% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2033 | 102.194 | 112.563 |
| CCILs | EUR 75.000.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,440% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2025 | 93.371 | 93.812 |
| CCILs | EUR 17.400.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,475% | Bank of America Merrill Lynch | 3/1/2028 | 29.781 | 21.365 |
| CCILs | EUR 15.500.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,528% | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2028 | (72.307) | (80.193) |
| CCILs | EUR 67.670.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,700% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2027 | 153.035 | 153.835 |
| CCILs | EUR 7.790.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 2,720% | Bank of America Merrill Lynch | 15/10/2027 | 103.082 | 103.174 |
| CCILs | EUR 32.980.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month FRCPXTOB and pays Fixed 2,690% | Bank of America Merrill Lynch | 15/1/2028 | 473.436 | 467.494 |
| CCILs | GBP 4.570.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,358% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2053 | 70.919 | 71.150 |
| CCILs | GBP 1.300.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,728% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2052 | 5.326 | 5.396 |
| CCILs | GBP 4.053.859 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,750% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2052 | 136.515 | (14.664) |
| CCILs | GBP 31.118.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 5,340% | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2027 | (531.363) | (530.934) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCILS | USD 172.370.000 | Fund receives Floating USD 12 Month CPURNSA and pays Fixed 2,665% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2024 | 191.911 | 192.533 |
| CCIRS | USD 2.500.000 | Fund receives Fixed 0,176% and pays Floating USD 12 Month SOFR | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2025 | (205.974) | (205.974) |
| CCIRS | EUR 18.000.000 | Fund receives Fixed 1,439% and pays Floating EUR 3 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | (4.423.908) | (4.430.356) |
| CCIRS | CHF 5.370.000 | Fund receives Fixed 1,856% and pays Floating CHF 12 Month SARON | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2053 | 41.977 | 29.130 |
| CCIRS | EUR 14.156.000 | Fund receives Fixed 2,287% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2073 | 374.476 | 129.982 |
| CCIRS | EUR 76.180.000 | Fund receives Fixed 2,291% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 5/2/2028 | (323.042) | (322.543) |
| CCIRS | EUR 4.620.000 | Fund receives Fixed 2,400% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2073 | 203.007 | 191.204 |
| CCIRS | EUR 8.285.000 | Fund receives Fixed 2,408% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2048 | (376.016) | (375.732) |
| CCIRS | EUR 43.000.000 | Fund receives Fixed 2,410% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 30/3/2053 | (636.953) | (1.389.070) |
| CCIRS | EUR 8.115.000 | Fund receives Fixed 2,680% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 8/5/2033 | (31.274) | (51.281) |
| CCIRS | EUR 10.770.000 | Fund receives Fixed 2,681% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | 10.885 | 11.024 |
| CCIRS | EUR 11.380.000 | Fund receives Fixed 2,684% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | 13.139 | 13.286 |
| CCIRS | EUR 9.045.000 | Fund receives Fixed 2,690% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2033 | (35.958) | (46.999) |
| CCIRS | EUR 8.865.000 | Fund receives Fixed 2,701% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 20/3/2033 | (24.145) | (38.354) |
| CCIRS | EUR 12.080.000 | Fund receives Fixed 2,708% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 27/3/2033 | (35.973) | 25.996 |
| CCIRS | EUR 56.860.000 | Fund receives Fixed 2,728% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/4/2033 | 135.037 | 166.834 |
| CCIRS | EUR 18.950.000 | Fund receives Fixed 2,733% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 18/4/2033 | 56.219 | 56.464 |
| CCIRS | EUR 5.690.000 | Fund receives Fixed 2,743% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | 13.109 | 20.377 |
| CCIRS | EUR 35.630.000 | Fund receives Fixed 2,748% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2033 | 117.092 | 117.554 |
| CCIRS | EUR 5.380.000 | Fund receives Fixed 2,760% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 6/5/2043 | 4.596 | 4.722 |
| CCIRS | EUR 36.110.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 3/5/2033 | 162.586 | 156.291 |
| CCIRS | EUR 5.380.000 | Fund receives Fixed 2,770% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/5/2043 | 10.267 | 8.602 |
| CCIRS | EUR 14.770.000 | Fund receives Fixed 2,782% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 11/5/2043 | 34.506 | 34.854 |
| CCIRS | EUR 25.000.000 | Fund receives Fixed 2,800% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 5/5/2043 | 87.202 | 87.789 |
| CCIRS | EUR 17.505.000 | Fund receives Fixed 2,824% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2033 | 110.679 | 110.906 |
| CCIRS | EUR 4.530.000 | Fund receives Fixed 2,832% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2033 | 31.753 | 31.812 |
| CCIRS | EUR 14.765.000 | Fund receives Fixed 2,832% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 17/5/2043 | 85.259 | 85.606 |
| CCIRS | EUR 15.540.000 | Fund receives Fixed 2,839% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2033 | 112.207 | 112.408 |
| CCIRS | EUR 28.610.000 | Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2033 | 256.555 | 244.713 |
| CCIRS | EUR 4.954.454 | Fund receives Fixed 2,900% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 9/5/2043 | 32.198 | 35.331 |
| CCIRS | EUR 14.160.000 | Fund receives Fixed 2,962% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | 42.583 | 44.616 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-----------------|--|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 9.610.000 | Fund receives Fixed 2,989% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2043 | 194.972 | 195.241 |
| CCIRS | EUR 4.954.454 | Fund receives Fixed 3,000% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 21/4/2043 | 99.744 | 107.792 |
| CCIRS | EUR 3.656.000 | Fund receives Fixed 3,000% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2043 | 81.900 | 80.363 |
| CCIRS | GBP 4.490.000 | Fund receives Fixed 3,090% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 2/2/2027 | (44.781) | (44.396) |
| CCIRS | GBP 9.200.000 | Fund receives Fixed 3,175% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 26/1/2028 | (59.479) | (59.183) |
| CCIRS | GBP 19.570.000 | Fund receives Fixed 3,197% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2028 | (115.219) | (116.777) |
| CCIRS | GBP 56.390.000 | Fund receives Fixed 3,200% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 26/1/2028 | (367.607) | (349.431) |
| CCIRS | GBP 77.750.000 | Fund receives Fixed 3,447% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 16/3/2027 | (584.874) | (469.595) |
| CCIRS | EUR 59.980.000 | Fund receives Fixed 3,575% and pays Floating EUR 12 Month ESTR | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2025 | 302.397 | 302.562 |
| CCIRS | GBP 28.410.000 | Fund receives Fixed 3,600% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 17/3/2026 | (225.208) | (226.486) |
| CCIRS | GBP 320.390.000 | Fund receives Fixed 3,677% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 9/3/2027 | (1.462.587) | (1.235.542) |
| CCIRS | GBP 15.100.000 | Fund receives Fixed 3,700% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2026 | (102.854) | (102.807) |
| CCIRS | GBP 33.970.000 | Fund receives Fixed 3,753% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 17/3/2026 | (306.177) | (217.865) |
| CCIRS | GBP 35.750.000 | Fund receives Fixed 4,056% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2028 | (761.910) | (761.375) |
| CCIRS | GBP 89.590.000 | Fund receives Fixed 4,172% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 4/4/2025 | (1.579.533) | (1.649.934) |
| CCIRS | GBP 19.290.000 | Fund receives Fixed 4,190% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/4/2026 | (384.406) | (382.602) |
| CCIRS | GBP 22.680.000 | Fund receives Fixed 4,255% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 15/5/2026 | (402.076) | (401.890) |
| CCIRS | GBP 73.770.000 | Fund receives Fixed 4,272% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 14/2/2025 | (1.186.646) | (1.187.039) |
| CCIRS | GBP 92.300.000 | Fund receives Fixed 4,287% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 28/4/2026 | (1.553.403) | (1.552.874) |
| CCIRS | GBP 45.320.000 | Fund receives Fixed 4,298% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 28/4/2026 | (747.130) | (746.887) |
| CCIRS | GBP 71.120.000 | Fund receives Fixed 4,505% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 18/5/2025 | (773.373) | (832.233) |
| CCIRS | GBP 94.610.000 | Fund receives Fixed 4,560% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2025 | (1.007.097) | (1.008.065) |
| CCIRS | GBP 45.690.000 | Fund receives Fixed 4,576% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 19/4/2025 | (471.857) | (472.177) |
| CCIRS | GBP 113.030.000 | Fund receives Fixed 4,777% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 23/5/2025 | (674.925) | (664.749) |
| CCIRS | GBP 22.610.000 | Fund receives Fixed 5,115% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2025 | 31.823 | 31.457 |
| CCIRS | GBP 22.610.000 | Fund receives Fixed 5,254% and pays Floating GBP 12 Month SONIA | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2025 | 99.523 | 99.057 |
| CCIRS | CHF 13.590.000 | Fund receives Floating CHF 12 Month SARON and pays Fixed 1,912% | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2033 | (153.198) | (139.928) |
| CCIRS | CHF 58.110.000 | Fund receives Floating CHF 12 Month SARON and pays Fixed 2,120% | Bank of America Merrill Lynch | 11/3/2025 | (204.443) | (204.282) |
| CCIRS | EUR 39.680.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 2,875% | Bank of America Merrill Lynch | 4/5/2028 | (215.233) | (214.844) |
| CCIRS | EUR 40.110.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,010% | Bank of America Merrill Lynch | 20/3/2025 | 154.309 | 222.818 |
| CCIRS | EUR 36.705.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,060% | Bank of America Merrill Lynch | 8/5/2025 | 124.728 | 153.500 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|--------------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | EUR 40.690.000 | Fund receives Floating EUR 12 Month ESTR and pays Fixed 3,140% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2025 | 143.910 | 137.082 |
| CCIRS | EUR 4.730.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,004% | Bank of America Merrill Lynch | 25/9/2050 | 2.386.433 | 2.386.613 |
| CCIRS | EUR 5.733.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed -0,025% | Bank of America Merrill Lynch | 21/1/2061 | 3.341.830 | 3.342.048 |
| CCIRS | EUR 13.769.797 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533% | Bank of America Merrill Lynch | 4/12/2049 | 5.493.198 | 5.493.198 |
| CCIRS | EUR 18.000.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,400% | Bank of America Merrill Lynch | 26/4/2052 | 4.314.306 | 4.322.040 |
| CCIRS | EUR 6.800.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,089% | Bank of America Merrill Lynch | 23/1/2053 | 688.818 | 689.061 |
| CCIRS | EUR 10.422.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,133% | Bank of America Merrill Lynch | 4/10/2052 | 968.618 | 968.990 |
| CCIRS | EUR 21.240.084 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,270% | Bank of America Merrill Lynch | 4/3/2053 | 1.370.623 | 1.371.383 |
| CCIRS | EUR 10.896.592 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,294% | Bank of America Merrill Lynch | 25/5/2054 | 466.684 | 613.969 |
| CCIRS | EUR 5.500.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,360% | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2073 | (163.592) | (163.356) |
| CCIRS | EUR 43.000.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,410% | Bank of America Merrill Lynch | 30/3/2053 | 721.823 | 1.512.019 |
| CCIRS | EUR 10.497.084 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,418% | Bank of America Merrill Lynch | 22/6/2054 | 314.885 | 315.310 |
| CCIRS | EUR 5.700.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,508% | Bank of America Merrill Lynch | 31/3/2053 | 89.039 | 87.457 |
| CCIRS | EUR 100.000.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,519% | Bank of America Merrill Lynch | 16/9/2027 | 2.046.968 | 2.047.948 |
| CCIRS | EUR 7.400.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,527% | Bank of America Merrill Lynch | 15/3/2030 | 187.568 | 187.682 |
| CCIRS | EUR 7.000.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,607% | Bank of America Merrill Lynch | 27/2/2053 | (25.601) | (25.351) |
| CCIRS | EUR 46.000.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,640% | Bank of America Merrill Lynch | 25/11/2029 | 876.686 | 877.314 |
| CCIRS | EUR 20.437.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,669% | Bank of America Merrill Lynch | 2/3/2053 | (597.157) | (331.241) |
| CCIRS | EUR 8.285.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,723% | Bank of America Merrill Lynch | 15/8/2048 | (120.151) | (28.324) |
| CCIRS | EUR 20.200.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,727% | Bank of America Merrill Lynch | 4/11/2042 | 363.997 | 425.574 |
| CCIRS | EUR 6.700.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,730% | Bank of America Merrill Lynch | 22/5/2053 | (198.605) | (194.957) |
| CCIRS | EUR 15.774.665 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,756% | Bank of America Merrill Lynch | 25/1/2033 | 232.100 | 232.372 |
| CCIRS | EUR 15.428.571 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,906% | Bank of America Merrill Lynch | 12/1/2033 | 34.725 | 34.991 |
| CCIRS | EUR 16.300.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,912% | Bank of America Merrill Lynch | 22/6/2043 | (146.299) | (145.798) |
| CCIRS | EUR 32.000.000 | Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 3,144% | Bank of America Merrill Lynch | 15/12/2028 | (244.110) | (243.753) |
| CCIRS | GBP 7.771.000 | Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 3,548% | Bank of America Merrill Lynch | 10/8/2048 | 532.425 | 531.041 |
| CCIRS | JPY 6.593.525.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,230% | Bank of America Merrill Lynch | 11/1/2025 | (125.631) | (125.408) |
| CCIRS | JPY 11.598.000.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,235% | Bank of America Merrill Lynch | 19/1/2025 | (227.903) | (227.507) |
| CCIRS | JPY 4.873.475.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,265% | Bank of America Merrill Lynch | 12/1/2025 | (111.397) | (111.233) |
| CCIRS | JPY 6.759.630.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,272% | Bank of America Merrill Lynch | 6/1/2025 | (159.079) | (158.845) |
| CCIRS | JPY 4.697.370.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,281% | Bank of America Merrill Lynch | 6/1/2025 | (114.878) | (114.716) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|-------------------|---|-------------------------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CCIRS | JPY 2.765.000.000 | Fund receives Floating JPY 12 Month TONA and pays Fixed 0,479% | Bank of America Merrill Lynch | 20/1/2028 | (187.187) | (186.965) |
| CCIRS | USD 2.500.000 | Fund receives Floating USD 12 Month FEDL and pays Fixed 0,182% | Bank of America Merrill Lynch | 20/10/2025 | 206.229 | 206.229 |
| CCIRS | USD 387.480.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,353% | Bank of America Merrill Lynch | 10/3/2027 | (782.122) | (1.244.194) |
| CCIRS | USD 118.060.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,639% | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2026 | 726.687 | 727.545 |
| CCIRS | USD 56.010.000 | Fund receives Floating USD 12 Month SOFR and pays Fixed 3,652% | Bank of America Merrill Lynch | 2/5/2026 | 325.386 | 325.793 |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on Banco Santander SA and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2027 | (22.039) | 13.193 |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2027 | (15.331) | (8.801) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 2.311 | (14.107) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2027 | 1.148 | (7.053) |
| CDS | USD 20.000.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Lowe's Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2025 | 21.499 | 321.833 |
| CDS | USD 20.000.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on NextEra Energy Capital Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2024 | (15.049) | 133.580 |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Bank of America Merrill Lynch | 20/12/2026 | 247 | (4.351) |
| CDS | EUR 449.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Stena AB | Bank of America Merrill Lynch | 20/6/2028 | (4.373) | 6.228 |
| CDS | EUR 296.667 | Fund receives default protection on Altice France SA and pays Fixed 5,000% | Barclays Bank | 20/12/2027 | 23.374 | 45.624 |
| CDS | USD 1.025.641 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (1.252) | (15.107) |
| CDS | USD 1.538.461 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (1.911) | (22.660) |
| CDS | USD 1.025.641 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (1.274) | (15.107) |
| CDS | USD 8.217.949 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (10.695) | (121.045) |
| CDS | EUR 275.000 | Fund receives default protection on Koninklijke DSM NV and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2027 | (3.065) | (7.636) |
| CDS | USD 8.306.243 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/6/2028 | (29.420) | 56.235 |
| CDS | EUR 1.200.000 | Fund receives default protection on Standard Chartered Plc and pays Fixed 1,000% | Barclays Bank | 20/12/2027 | (29.467) | 20.259 |
| CDS | EUR 456.668 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Barclays Bank | 20/12/2027 | 30.836 | (85.614) |
| CDS | EUR 296.667 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA | Barclays Bank | 20/12/2025 | (17.277) | (23.581) |
| CDS | EUR 100.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Telecom Italia SpA | Barclays Bank | 20/12/2024 | 460 | 4.570 |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | Barclays Bank | 20/6/2027 | (13.360) | (30.750) |
| CDS | EUR 550.000 | Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo SpA and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/12/2027 | (12.228) | 29.764 |
| CDS | EUR 825.000 | Fund receives default protection on Koninklijke DSM NV and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/6/2027 | (8.016) | (22.908) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on NatWest Group Plc and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/12/2027 | (20.252) | 11.536 |
| CDS | USD 6.627.490 | Fund receives default protection on Prudential Financial Inc and pays Fixed 1,000% | BNP Paribas | 20/6/2028 | 992 | 28.279 |
| CDS | EUR 139.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | BNP Paribas | 20/12/2023 | (84.738) | (96.553) |
| CDS | EUR 83.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | BNP Paribas | 20/12/2027 | 10.404 | 7.358 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 400.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | BNP Paribas | 20/6/2026 | 13.710 | (8.290) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | BNP Paribas | 20/6/2027 | (15.009) | (30.750) |
| CDS | EUR 1.240.000 | Fund receives default protection on Electricite de France SA and pays Fixed 1,000% | Citibank | 20/6/2025 | (3.955) | (9.789) |
| CDS | EUR 132.511 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Citibank | 20/12/2027 | 9.942 | (24.843) |
| CDS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | Citibank | 20/6/2023 | (7.588) | (22.088) |
| CDS | EUR 11.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | Credit Suisse | 20/6/2023 | 1.370 | (1.215) |
| CDS | EUR 680.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/12/2027 | 82.831 | 60.280 |
| CDS | EUR 270.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Credit Suisse | 20/12/2027 | 30.810 | 23.935 |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB | Credit Suisse | 20/12/2026 | (23.223) | (14.334) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Credit Suisse | 20/12/2023 | 29.194 | 8.194 |
| CDS | EUR 1.365.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Credit Suisse | 20/12/2023 | 63.003 | 18.640 |
| CDS | EUR 150.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Credit Suisse | 20/12/2026 | (10.966) | (5.439) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on K+S AG | Credit Suisse | 20/12/2026 | (1.073) | 27.796 |
| CDS | USD 35.540.000 | Fund receives default protection on Comcast Corp and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2028 | (108.040) | (677.741) |
| CDS | USD 10.657.607 | Fund receives default protection on Dow Chemical Co and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2028 | (26.836) | 8.469 |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | Deutsche Bank | 20/6/2027 | (1.364) | (14.107) |
| CDS | EUR 139.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | Deutsche Bank | 20/6/2028 | 5.767 | (101.263) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2027 | (15.310) | (8.801) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2027 | (7.525) | (4.400) |
| CDS | USD 2.099.889 | Fund receives default protection on Lincoln National Corp and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (1.357) | 140.242 |
| CDS | USD 6.878.307 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | 4.288 | 46.567 |
| CDS | USD 2.751.323 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (575) | 18.627 |
| CDS | USD 2.751.323 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (575) | 18.627 |
| CDS | USD 6.877.843 | Fund receives default protection on Prudential Financial Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (12.930) | 29.347 |
| CDS | USD 5.502.275 | Fund receives default protection on Prudential Financial Inc and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/6/2028 | (5.936) | 23.477 |
| CDS | EUR 550.000 | Fund receives default protection on UniCredit SpA and pays Fixed 1,000% | Goldman Sachs | 20/12/2027 | (14.039) | 27.385 |
| CDS | EUR 120.000 | Fund receives default protection on Vue International Bidco Plc and pays Fixed 5,000% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 779 | 12.779 |
| CDS | EUR 180.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (35.769) | (21.501) |
| CDS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Goldman Sachs | 20/12/2023 | 9.231 | 2.731 |
| CDS | EUR 80.904 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Goldman Sachs | 20/12/2026 | (5.626) | (2.933) |
| CDS | EUR 76.433 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Novafives SAS | Goldman Sachs | 20/6/2023 | 5.374 | 23 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|----------------|--|---------------|---------------|---|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 43.567 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Novafives SAS | Goldman Sachs | 20/6/2023 | 3.281 | 13 |
| CDS | EUR 153.440 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on TK Elevator Holdco GmbH | Goldman Sachs | 20/12/2026 | 3.462 | 5.650 |
| CDS | EUR 190.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | Goldman Sachs | 20/6/2027 | (475) | (19.475) |
| CDS | EUR 385.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | Goldman Sachs | 20/12/2027 | 1.657 | (45.986) |
| CDS | EUR 142.857 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Vue International Bidco Plc | Goldman Sachs | 20/6/2026 | (12.072) | (18.500) |
| CDS | EUR 593.333 | Fund receives default protection on Altice France SA and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/12/2027 | 43.781 | 91.248 |
| CDS | EUR 1.200.000 | Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2027 | (34.334) | (21.086) |
| CDS | USD 39.230.000 | Fund receives default protection on Comcast Corp and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (298.048) | (748.109) |
| CDS | USD 5.128.205 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (10.503) | (75.535) |
| CDS | USD 2.564.103 | Fund receives default protection on CVS Health Corp and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (3.055) | (37.768) |
| CDS | EUR 5.533.000 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 95.589 | 33.983 |
| CDS | EUR 2.564.294 | Fund receives default protection on ING Groep NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2026 | 27.961 | 15.750 |
| CDS | USD 2.751.323 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (9.745) | 18.627 |
| CDS | USD 4.126.984 | Fund receives default protection on MetLife Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (5.904) | 27.940 |
| CDS | EUR 180.000 | Fund receives default protection on Monitchem HoldCo 3 SA and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | 11.980 | 3.289 |
| CDS | EUR 180.000 | Fund receives default protection on Monitchem HoldCo 3 SA and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | 11.142 | 3.289 |
| CDS | USD 6.877.843 | Fund receives default protection on Prudential Financial Inc and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2028 | (27.509) | 29.347 |
| CDS | EUR 950.000 | Fund receives default protection on Stellantis NV and pays Fixed 5,000% | JP Morgan | 20/12/2027 | (14.948) | (131.512) |
| CDS | EUR 900.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | 5.216 | (21.160) |
| CDS | EUR 580.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | (1.001) | (13.637) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/6/2027 | (2.864) | (14.107) |
| CDS | EUR 551.000 | Fund receives default protection on UniCredit SpA and pays Fixed 1,000% | JP Morgan | 20/12/2027 | (9.257) | 27.435 |
| CDS | USD 37.210.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Bank of America Corp | JP Morgan | 20/6/2028 | 219.277 | 64.521 |
| CDS | USD 10.657.607 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Sherwin-Williams Co | JP Morgan | 20/6/2028 | 77.691 | 69.699 |
| CDS | EUR 450.000 | Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on thyssenkrupp AG | JP Morgan | 20/12/2023 | 10.090 | 479 |
| CDS | EUR 121.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | JP Morgan | 20/12/2024 | 4.963 | (9.557) |
| CDS | EUR 277.313 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | JP Morgan | 20/12/2027 | 17.339 | (51.989) |
| CDS | EUR 593.333 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA | JP Morgan | 20/12/2025 | (33.813) | (47.163) |
| CDS | EUR 60.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | JP Morgan | 20/6/2023 | 4.774 | (6.626) |
| CDS | EUR 140.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA | JP Morgan | 20/6/2028 | (3.642) | (101.992) |
| CDS | EUR 200.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB | JP Morgan | 20/6/2027 | (13.402) | (26.902) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Typ | Nennwert | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|--------------------|--|----------------------------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| SWAPS | | | | | | |
| CDS | EUR 894.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Loxam SAS | JP Morgan | 20/6/2028 | 46.276 | (63.239) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV | JP Morgan | 20/6/2027 | (11.192) | (30.750) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2027 | (12.289) | (5.272) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2027 | (24.579) | (10.543) |
| CDS | EUR 600.000 | Fund receives default protection on BMW Finance NV and pays Fixed 1,000% | Morgan Stanley | 20/12/2027 | (14.306) | (8.801) |
| CDS | EUR 425.532 | Fund receives default protection on Naturgy Capital Markets SA and pays Fixed 5,000% | Morgan Stanley | 20/6/2027 | (5.658) | (6.444) |
| CDS | EUR 201.068 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG | Morgan Stanley | 20/12/2027 | 12.572 | (37.695) |
| CDS | EUR 300.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA | Morgan Stanley | 20/12/2027 | 34.782 | 26.594 |
| CDS | EUR 50.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc | Morgan Stanley | 20/12/2026 | (4.006) | (1.813) |
| CDS | EUR 3.000.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Naturgy Capital Markets SA | Morgan Stanley | 20/6/2023 | 11.349 | 961 |
| CDS | EUR 140.000 | Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Vue International Bidco Plc | Morgan Stanley | 20/6/2026 | (11.130) | (18.130) |
| IRS | KRW 95.711.775.000 | Fund receives Fixed 1,590% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (444.192) | (444.192) |
| IRS | KRW 38.763.286.800 | Fund receives Fixed 1,630% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | Bank of America Merrill Lynch | 21/9/2023 | (176.543) | (176.543) |
| IRS | KRW 79.759.775.000 | Fund receives Fixed 1,632% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | BNP Paribas | 21/9/2023 | (362.912) | (362.912) |
| IRS | KRW 40.996.563.200 | Fund receives Fixed 1,643% and pays Floating KRW 3 Month KWDC | HSBC | 21/9/2023 | (185.606) | (185.606) |
| TRS | EUR 197.500 | Fund receives Fixed 1,450% and pays International Design Group SpA | JP Morgan | 10/6/2024 | 3.655 | 3.655 |
| TRS | EUR 98.750 | Fund receives Fixed 1,450% and pays International Design Group SpA | JP Morgan | 10/6/2024 | 1.828 | 1.828 |
| TRS | EUR 234.186 | Fund receives Fixed -1,950% and pays Credit Suisse Group AG | JP Morgan | 18/6/2024 | (3.664) | (3.664) |
| TRS | EUR 233.879 | Fund receives Fixed -2,000% and pays Credit Suisse Group AG | JP Morgan | 18/6/2024 | (3.972) | (3.972) |
| TRS | EUR 380.600 | Fund receives Fixed 2,050% and pays Jaguar Land Rover Automotive Plc | JP Morgan | 10/6/2024 | (8.730) | (8.730) |
| TRS | EUR 443.700 | Fund receives Fixed 2,100% and pays Heimstaden Bostad Treasury BV | JP Morgan | 10/6/2024 | 6.998 | 6.998 |
| TRS | EUR 315.000 | Fund receives Fixed 2,300% and pays Vonovia SE | JP Morgan | 10/6/2024 | 4.791 | 4.791 |
| TRS | EUR 236.250 | Fund receives Fixed 2,300% and pays Vonovia SE | JP Morgan | 10/6/2024 | 3.593 | 3.593 |
| TRS | EUR 327.000 | Fund receives Fixed 2,425% and pays Erste Group Bank AG | JP Morgan | 10/6/2024 | (2.305) | (2.305) |
| TRS | EUR 327.000 | Fund receives Fixed 2,425% and pays Erste Group Bank AG | JP Morgan | 10/6/2024 | (2.305) | (2.305) |
| TRS | EUR 313.250 | Fund receives Fixed -2,750% and pays Quatrim SAS | JP Morgan | 10/6/2024 | 16.425 | 16.425 |
| TRS | GBP 191.400 | Fund receives Fixed 3,400% and pays Next Plc | JP Morgan | 11/6/2024 | 13.076 | 13.076 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 6.808.224.846) | | | | | (14.360.656) | (11.629.925) |

CCCDs: Zentral abgewickelte Credit Default Swaps
 CCILs: Zentral abgewickelte inflationsgebundene Swaps
 CCIRs: Zentral abgewickelte Zinsswaps
 CDS: Credit Default Swaps
 IRS: Zinsraten-Swaps
 TRS: Gesamtertrag-Swaps

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement EUR | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|-------------------------------------|-----------------|---|----------------|---|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (225) | USD | 3 Month SOFR Futures December 2023 | März 2024 | 50.152.199 | 137.450 |
| (335) | USD | 3 Month SOFR Futures September 2023 | Dezember 2023 | 74.408.291 | 373.835 |
| (355) | AUD | Australian 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 25.830.456 | (202.912) |
| (1.543) | EUR | Euro BOBL Futures June 2023 | Juni 2023 | 181.981.420 | (605.520) |
| (559) | EUR | Euro BTP Futures June 2023 | Juni 2023 | 64.642.760 | (990.855) |
| (1.610) | EUR | Euro Bund Futures June 2023 | Juni 2023 | 218.493.100 | (1.290.162) |
| (237) | EUR | Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 32.634.900 | (818.410) |
| (3.423) | EUR | Euro Schatz Futures June 2023 | Juni 2023 | 361.348.995 | 827.311 |
| (618) | EUR | Euro-OAT Futures June 2023 | Juni 2023 | 80.469.780 | (499.822) |
| (470) | JPY | Japan 10 Year Bond Futures June 2023 | Juni 2023 | 466.667.537 | (1.523.576) |
| 707 | GBP | Three Month SONIA Index Futures December 2024 | März 2025 | 195.448.636 | (723.385) |
| 477 | GBP | Three Month SONIA Index Futures March 2024 | Juni 2024 | 130.973.897 | (450.409) |
| 576 | GBP | Three Month SONIA Index Futures September 2023 | Dezember 2023 | 158.056.991 | (1.502.493) |
| 64 | GBP | Three Month SONIA Index Futures September 2024 | Dezember 2024 | 17.656.491 | (140.977) |
| 2.225 | GBP | UK Long Gilt Bond Futures September 2023 | September 2023 | 248.850.316 | 3.306.580 |
| (47) | USD | US Long Bond Futures September 2023 | September 2023 | 5.634.279 | (77.079) |
| 49 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures June 2023 | Juni 2023 | 5.211.486 | 7.887 |
| (49) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures June 2023 | Juni 2023 | 5.211.485 | 98.967 |
| (1.317) | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 148.378.380 | (801.859) |
| 541 | USD | US Treasury 10 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 57.974.476 | 489.448 |
| 547 | USD | US Treasury 2 Year Note Futures June 2023 | Juni 2023 | 104.855.829 | (100.117) |
| (547) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures June 2023 | Juni 2023 | 104.855.829 | 1.113.938 |
| 1.867 | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 360.062.016 | 779.930 |
| (29) | USD | US Treasury 2 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 5.592.822 | 5.517 |
| 124 | USD | US Treasury 5 Year Note Futures June 2023 | Juni 2023 | 12.593.979 | 10.671 |
| (124) | USD | US Treasury 5 Year Note Futures June 2023 | Juni 2023 | 12.593.979 | 194.203 |
| 991 | USD | US Treasury 5 Year Note Futures September 2023 | September 2023 | 101.230.345 | 466.444 |
| (167) | USD | US Ultra Bond Futures September 2023 | September 2023 | 21.310.002 | (342.390) |
| Gesamt | | | | | (2.257.785) |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Netto(-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|-------------------------------|---------------|---------------|--|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| 209.830.000 | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 123,25 | 06/06/2023 | (2.969.691) | 196 |
| 92.430.000 | Call | OTC EUR/USD | Deutsche Bank | EUR 1,13 | 19/07/2023 | (539.606) | 29.208 |
| 92.220.000 | Call | OTC EUR/USD | Goldman Sachs | EUR 1,14 | 16/06/2023 | (283.208) | 92 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 0) | | | | | | (3.792.505) | 29.496 |

| Anzahl der Kontrakte | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nicht realisierter Nettogewinn EUR | Marktwert EUR |
|--|-----------|-----------------------|-------------------------------|---------------|---------------|------------------------------------|---------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE OPTIONEN | | | | | | | |
| (209.830.000) | Put | OTC USD/JPY | Bank of America Merrill Lynch | USD 121,31 | 06/06/2023 | 2.270.488 | (196) |
| (92.430.000) | Call | OTC EUR/USD | Deutsche Bank | EUR 1,15 | 19/07/2023 | 200.850 | (4.899) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 0) | | | | | | 2.471.338 | (5.095) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|---|--------------|--|----------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| GEKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| 17.700.000 | Call | Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed semi-annually from 10/7/2023; and pays Floating USD 12 Month SOFR annually from 12/7/2024 | Citibank | USD 3,00 | 10/07/2023 | (101.297) | 56.580 |
| 141.000.000 | Call | Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2023; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 0,85 | 21/06/2023 | 109.571 | 327.557 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 81.708.335) | | | | | | 8.274 | 384.137 |

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|-------------------------------------|--------------|---|---------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (87.075.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed annually from 25/8/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 25/8/2024 | Citibank | GBP 4,75 | 25/08/2023 | (467.711) | (844.836) |
| (623.430.000) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,9% Fixed semi-annually from 1/12/2023; and pays Floating USD 12 Month SOFR annually from 5/12/2024 | Citibank | USD 3,90 | 01/12/2023 | (707.852) | (4.438.484) |
| (79.699.545) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,7% Fixed annually from 14/6/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 14/6/2024 | Citibank | GBP 4,70 | 14/06/2023 | (133.467) | (595.527) |
| (63.283.818) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,7% Fixed annually from 14/6/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 14/6/2024 | Citibank | GBP 4,70 | 14/06/2023 | (105.977) | (472.866) |
| (56.807.500) | Put | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,2% Fixed annually from 17/7/2023; and pays Floating GBP 12 Month SONIA annually from 17/7/2024 | Barclays Bank | GBP 4,20 | 17/07/2023 | (728.441) | (1.026.276) |
| (623.430.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD 12 Month SOFR annually from 19/1/2025; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 17/1/2024 | Citibank | USD 2,75 | 17/01/2024 | 578.079 | (2.697.083) |
| (46.900.000) | Call | Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD 12 Month SOFR annually from 25/3/2025; and pays 2,5% Fixed semi-annually from 21/3/2024 | JP Morgan | USD 2,50 | 21/03/2024 | 42.486 | (214.297) |
| (5.962.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 from 21/6/2023; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2023 | Citibank | EUR 4,25 | 21/06/2023 | 20.219 | (24.853) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Nennwert | Call/ Put | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Ausübungskurs | Verfalls- datum | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR | Marktwert EUR |
|--|--------------|---|----------------|---------------|--------------------|--|------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| VERKAUFTE SWAPTIONEN | | | | | | | |
| (4.520.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 from 19/7/2023; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 4,50 | 19/07/2023 | (7.652) | (52.897) |
| (141.000.000) | Put | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2023; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 39 Version 1 from 21/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 0,98 | 21/06/2023 | 129.698 | (50.783) |
| (1.519.000) | Call | Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1 from 19/7/2023; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2023 | Morgan Stanley | EUR 4,37 | 19/07/2023 | 213 | (13.458) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 709.889.415) | | | | | | (1.380.405) | (10.431.360) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|------------|---------|------------|-------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| AUD | 1.740.000 | EUR | 1.060.851 | Bank of America Merrill Lynch | 2/6/2023 | (5.036) |
| AUD | 23.770.000 | NZD | 25.483.270 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 122.326 |
| AUD | 9.110.000 | USD | 6.046.869 | Citibank | 21/6/2023 | (131.221) |
| AUD | 10.030.000 | USD | 6.723.450 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (206.142) |
| CAD | 2.560.000 | EUR | 1.755.216 | Goldman Sachs | 2/6/2023 | 5.046 |
| CHF | 3.040.000 | EUR | 3.087.748 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 35.218 |
| CHF | 3.040.000 | EUR | 3.104.775 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 18.192 |
| CHF | 3.030.000 | EUR | 3.094.966 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 17.728 |
| CHF | 1.530.000 | EUR | 1.547.289 | JP Morgan | 21/6/2023 | 24.467 |
| CHF | 6.080.000 | EUR | 6.210.085 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 35.848 |
| CNH | 46.900.000 | USD | 6.775.337 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | (173.825) |
| EUR | 1.039.509 | AUD | 1.740.000 | Toronto Dominion Bank | 2/6/2023 | (16.306) |
| EUR | 1.060.144 | AUD | 1.740.000 | Bank of America Merrill Lynch | 5/7/2023 | 5.061 |
| EUR | 1.697.393 | CAD | 2.560.000 | Standard Chartered Bank | 2/6/2023 | (62.869) |
| EUR | 1.753.250 | CAD | 2.560.000 | Goldman Sachs | 5/7/2023 | (5.245) |
| EUR | 163.337 | CHF | 160.000 | Royal Bank of Canada | 2/6/2023 | (852) |
| EUR | 102.711 | CHF | 100.000 | Goldman Sachs | 15/6/2023 | 18 |
| EUR | 1.547.982 | CHF | 1.520.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (13.502) |
| EUR | 1.548.987 | CHF | 1.530.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (22.769) |
| EUR | 1.545.876 | CHF | 1.520.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (15.608) |
| EUR | 9.309.360 | CHF | 9.120.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (59.540) |
| EUR | 3.098.324 | CHF | 3.030.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (14.369) |
| EUR | 5.172.280 | GBP | 4.520.000 | Barclays Bank | 2/6/2023 | (67.998) |
| EUR | 5.543.054 | GBP | 4.840.000 | BNP Paribas | 2/6/2023 | (68.217) |
| EUR | 2.222.250 | GBP | 1.960.000 | Deutsche Bank | 2/6/2023 | (50.083) |
| EUR | 3.045.117 | GBP | 2.700.000 | JP Morgan | 2/6/2023 | (85.137) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|---------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 10.870.080 | GBP | 9.450.000 | Morgan Stanley | 2/6/2023 | (85.811) |
| EUR | 13.866.093 | GBP | 12.050.000 | Natwest Markets | 2/6/2023 | (104.118) |
| EUR | 1.186.100 | GBP | 1.030.000 | Royal Bank of Canada | 2/6/2023 | (8.034) |
| EUR | 431.064.412 | GBP | 382.223.000 | Standard Chartered Bank | 2/6/2023 | (12.067.188) |
| EUR | 6.873.838 | GBP | 5.970.000 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2023 | (47.503) |
| EUR | 6.996.564 | GBP | 6.080.000 | UBS | 2/6/2023 | (52.306) |
| EUR | 17.331.969 | GBP | 15.050.000 | Barclays Bank | 15/6/2023 | (108.003) |
| EUR | 21.490.000 | GBP | 18.754.323 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (237.647) |
| EUR | 450.261.735 | GBP | 389.423.000 | Goldman Sachs | 5/7/2023 | (662.386) |
| EUR | 6.516.363 | HUF | 2.590.000.000 | Societe Generale | 21/6/2023 | (417.748) |
| EUR | 1.051.121 | JPY | 154.470.000 | Morgan Stanley | 2/6/2023 | 18.990 |
| EUR | 409.230 | JPY | 60.420.000 | Natwest Markets | 2/6/2023 | 5.518 |
| EUR | 2.159.379 | JPY | 319.570.000 | Royal Bank of Canada | 2/6/2023 | 24.089 |
| EUR | 3.106.718 | JPY | 456.890.000 | State Street Bank & Trust Company | 2/6/2023 | 53.888 |
| EUR | 2.258.709 | JPY | 337.990.000 | Bank of America Merrill Lynch | 5/7/2023 | (6.814) |
| EUR | 192.232 | NOK | 2.250.000 | Bank of America Merrill Lynch | 2/6/2023 | 3.362 |
| EUR | 5.985.968 | NOK | 69.900.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 119.429 |
| EUR | 4.457.626 | NOK | 51.900.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 101.782 |
| EUR | 1.419.795 | NOK | 16.700.000 | Citibank | 21/6/2023 | 18.204 |
| EUR | 20.287.529 | NOK | 234.900.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 572.936 |
| EUR | 19.318.632 | NOK | 223.100.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 594.383 |
| EUR | 2.805.715 | NOK | 33.100.000 | HSBC | 21/6/2023 | 27.712 |
| EUR | 2.778.780 | NOK | 32.900.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 17.561 |
| EUR | 20.356.623 | NOK | 238.800.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 314.711 |
| EUR | 1.534.557 | NOK | 17.600.000 | Natwest Markets | 21/6/2023 | 57.432 |
| EUR | 2.774.847 | NOK | 32.800.000 | Royal Bank of Canada | 21/6/2023 | 22.021 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|----------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| EUR | 44.411.772 | NZD | 80.230.000 | Australia and New Zealand Banking | 2/6/2023 | (649.293) |
| EUR | 38.575.091 | NZD | 68.530.000 | Westpac | 5/7/2023 | 165.693 |
| EUR | 5.760.015 | SEK | 64.800.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 177.145 |
| EUR | 16.421.482 | USD | 17.820.000 | Bank of America Merrill Lynch | 2/6/2023 | (267.820) |
| EUR | 1.412.489 | USD | 1.560.000 | BNP Paribas | 2/6/2023 | (48.527) |
| EUR | 2.868.570 | USD | 3.170.000 | Goldman Sachs | 2/6/2023 | (100.290) |
| EUR | 3.346.228 | USD | 3.610.000 | HSBC | 2/6/2023 | (34.714) |
| EUR | 3.188.679 | USD | 3.500.000 | Societe Generale | 2/6/2023 | (89.243) |
| EUR | 183.380.717 | USD | 203.011.000 | Standard Chartered Bank | 2/6/2023 | (6.749.032) |
| EUR | 5.420.502 | USD | 5.950.000 | Citibank | 15/6/2023 | (147.770) |
| EUR | 9.311 | USD | 10.000 | HSBC | 15/6/2023 | (48) |
| EUR | 9.333 | USD | 10.000 | Morgan Stanley | 15/6/2023 | (26) |
| EUR | 21.490.000 | USD | 23.542.338 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (534.018) |
| EUR | 126.584.738 | USD | 137.134.733 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (1.705.741) |
| EUR | 89.320.000 | USD | 96.541.139 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (994.894) |
| EUR | 45.200.000 | USD | 48.397.542 | Citibank | 21/6/2023 | (76.231) |
| EUR | 42.910.000 | USD | 46.138.654 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (253.026) |
| EUR | 15.450.000 | USD | 16.876.931 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (338.484) |
| EUR | 162.105.262 | USD | 177.575.574 | JP Morgan | 21/6/2023 | (4.017.898) |
| EUR | 51.360.000 | USD | 56.228.315 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (1.241.972) |
| EUR | 18.010.000 | USD | 19.922.194 | Societe Generale | 21/6/2023 | (627.348) |
| EUR | 8.710.239 | USD | 9.330.000 | Societe Generale | 5/7/2023 | (10.756) |
| EUR | 189.899.275 | USD | 204.332.000 | UBS | 5/7/2023 | (1.095.200) |
| EUR | 13.292.405 | ZAR | 271.390.000 | Goldman Sachs | 2/6/2023 | 379.328 |
| EUR | 7.370.077 | ZAR | 149.810.000 | HSBC | 2/6/2023 | 241.929 |
| EUR | 8.327.925 | ZAR | 173.540.000 | UBS | 2/6/2023 | 70.674 |
| EUR | 27.970.345 | ZAR | 594.740.000 | Citibank | 5/7/2023 | (182.150) |
| GBP | 11.290.000 | EUR | 12.993.578 | Barclays Bank | 2/6/2023 | 95.524 |
| GBP | 3.000.000 | EUR | 3.441.585 | BNP Paribas | 2/6/2023 | 36.476 |
| GBP | 4.390.000 | EUR | 5.044.805 | Deutsche Bank | 2/6/2023 | 44.757 |
| GBP | 389.423.000 | EUR | 450.829.754 | Goldman Sachs | 2/6/2023 | 649.190 |
| GBP | 6.650.000 | EUR | 7.648.856 | JP Morgan | 2/6/2023 | 60.846 |
| GBP | 16.070.000 | EUR | 18.491.634 | Morgan Stanley | 2/6/2023 | 139.178 |
| GBP | 18.679.774 | EUR | 21.490.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 151.279 |
| GBP | 36.120.000 | USD | 44.649.302 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 76.764 |
| GBP | 29.900.000 | USD | 36.633.368 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 369.602 |
| GBP | 2.720.000 | USD | 3.389.236 | Citibank | 21/6/2023 | (19.423) |
| GBP | 18.460.000 | USD | 22.966.769 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (98.908) |
| GBP | 1.360.000 | USD | 1.685.656 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (1.327) |
| GBP | 48.530.000 | USD | 59.189.136 | HSBC | 21/6/2023 | 852.140 |
| GBP | 21.890.000 | USD | 26.921.416 | JP Morgan | 21/6/2023 | 175.287 |
| GBP | 35.310.000 | USD | 43.927.097 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (186.027) |
| GBP | 4.080.000 | USD | 5.050.766 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 1.821 |
| GBP | 13.810.000 | USD | 16.667.151 | Toronto Dominion Bank | 21/6/2023 | 407.214 |
| HUF | 2.590.000.000 | EUR | 6.291.432 | UBS | 21/6/2023 | 642.678 |
| JPY | 337.990.000 | EUR | 2.251.487 | Bank of America Merrill Lynch | 2/6/2023 | 6.882 |
| JPY | 653.360.000 | EUR | 4.344.977 | Morgan Stanley | 2/6/2023 | 20.618 |
| JPY | 1.050.000.000 | EUR | 7.167.868 | JP Morgan | 21/6/2023 | (139.360) |
| JPY | 7.472.180.000 | USD | 56.295.497 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (2.647.419) |
| JPY | 5.448.690.000 | USD | 40.603.200 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (1.512.038) |
| JPY | 12.882.000.000 | USD | 99.478.270 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (6.832.852) |
| JPY | 6.691.820.000 | USD | 50.179.343 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (2.149.300) |
| NOK | 50.100.000 | EUR | 4.265.419 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (60.647) |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--------------------------------------|-------------|---------|-------------|-------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| NOK | 34.400.000 | EUR | 3.024.699 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (137.589) |
| NOK | 34.700.000 | EUR | 2.960.685 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (48.397) |
| NOK | 254.400.000 | EUR | 21.923.962 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (572.781) |
| NOK | 312.300.000 | EUR | 26.878.706 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (668.116) |
| NOK | 84.700.000 | EUR | 7.261.311 | HSBC | 21/6/2023 | (152.643) |
| NOK | 126.666.724 | EUR | 11.068.569 | JP Morgan | 21/6/2023 | (437.736) |
| NOK | 114.533.277 | EUR | 9.754.255 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (141.751) |
| NOK | 65.600.000 | EUR | 5.532.088 | Royal Bank of Canada | 21/6/2023 | (26.437) |
| NOK | 70.700.000 | EUR | 6.163.664 | Societe Generale | 21/6/2023 | (229.983) |
| NOK | 17.700.000 | EUR | 1.538.226 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (52.707) |
| NOK | 33.100.000 | EUR | 2.805.569 | UBS | 21/6/2023 | (27.566) |
| NOK | 70.700.000 | SEK | 69.554.203 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (58.790) |
| NOK | 17.800.000 | SEK | 17.584.798 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (21.114) |
| NOK | 70.900.000 | SEK | 70.256.469 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (102.509) |
| NOK | 17.800.000 | SEK | 17.578.390 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (20.562) |
| NOK | 17.500.000 | SEK | 17.021.637 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 2.227 |
| NOK | 145.270.000 | USD | 13.733.300 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (655.434) |
| NOK | 373.910.000 | USD | 35.355.120 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (1.693.587) |
| NOK | 38.600.000 | USD | 3.639.655 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (165.317) |
| NOK | 13.400.000 | USD | 1.298.683 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (90.297) |
| NOK | 5.900.000 | USD | 559.631 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (28.366) |
| NOK | 6.830.000 | USD | 660.663 | Societe Generale | 21/6/2023 | (44.829) |
| NZD | 25.164.229 | AUD | 23.770.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (301.298) |
| NZD | 11.700.000 | EUR | 6.791.952 | Bank of America Merrill Lynch | 2/6/2023 | (220.664) |
| NZD | 68.530.000 | EUR | 38.655.273 | Westpac | 2/6/2023 | (165.496) |
| NZD | 16.400.000 | USD | 10.171.971 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (316.036) |
| NZD | 9.660.000 | USD | 5.826.412 | Citibank | 21/6/2023 | (31.675) |
| NZD | 10.760.000 | USD | 6.764.651 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (292.337) |
| NZD | 9.660.000 | USD | 5.839.673 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (44.081) |
| SEK | 64.800.000 | EUR | 5.624.218 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (41.347) |
| SEK | 17.610.216 | NOK | 17.800.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 23.304 |
| SEK | 17.564.684 | NOK | 17.800.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 19.381 |
| SEK | 52.547.070 | NOK | 53.200.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 62.266 |
| SEK | 17.883.522 | NOK | 18.000.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 30.065 |
| SEK | 34.571.036 | NOK | 35.300.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 15.837 |
| SEK | 17.152.161 | NOK | 17.500.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 9.019 |
| SEK | 34.993.868 | NOK | 35.100.000 | Societe Generale | 21/6/2023 | 69.052 |
| SEK | 10.300.000 | USD | 988.474 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | (37.324) |
| SEK | 186.030.000 | USD | 18.099.864 | JP Morgan | 21/6/2023 | (905.055) |
| SEK | 6.900.000 | USD | 650.230 | Societe Generale | 21/6/2023 | (13.823) |
| USD | 5.944.690 | AUD | 9.110.000 | Citibank | 21/6/2023 | 35.632 |
| USD | 6.740.240 | AUD | 10.030.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 221.849 |
| USD | 6.764.572 | CNH | 46.900.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 163.755 |
| USD | 15.660.000 | EUR | 14.226.803 | Morgan Stanley | 2/6/2023 | 439.555 |
| USD | 12.679.000 | EUR | 11.702.909 | Royal Bank of Canada | 2/6/2023 | 171.595 |
| USD | 204.332.000 | EUR | 190.272.747 | UBS | 2/6/2023 | 1.094.184 |
| USD | 9.861.215 | EUR | 9.100.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 125.234 |
| USD | 48.484.845 | EUR | 44.440.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 917.905 |
| USD | 89.925.848 | EUR | 82.600.000 | Citibank | 21/6/2023 | 1.526.245 |
| USD | 119.282.469 | EUR | 109.740.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 1.849.563 |
| USD | 21.682.050 | EUR | 19.545.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 738.706 |
| USD | 6.707.699 | EUR | 6.120.000 | HSBC | 21/6/2023 | 155.098 |
| USD | 219.194.537 | EUR | 201.395.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 3.662.984 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|---|-------------|---------|----------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| USD | 106.918.992 | EUR | 99.490.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 533.447 |
| USD | 15.800.000 | EUR | 14.862.335 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | (81.327) |
| USD | 50.286.384 | GBP | 41.610.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | (1.163.624) |
| USD | 28.613.060 | GBP | 23.250.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | (168.358) |
| USD | 33.650.510 | GBP | 27.800.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | (727.150) |
| USD | 16.787.898 | GBP | 13.780.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | (259.497) |
| USD | 22.976.736 | GBP | 18.460.000 | HSBC | 21/6/2023 | 108.232 |
| USD | 25.148.559 | GBP | 20.080.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 263.151 |
| USD | 79.536.147 | GBP | 64.480.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | (296.096) |
| USD | 1.682.587 | GBP | 1.360.000 | Royal Bank of Canada | 21/6/2023 | (1.544) |
| USD | 1.686.159 | GBP | 1.360.000 | Standard Chartered Bank | 21/6/2023 | 1.798 |
| USD | 27.301.134 | JPY | 3.701.310.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 764.506 |
| USD | 53.424.821 | JPY | 6.914.400.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 3.695.558 |
| USD | 13.255.889 | JPY | 1.771.000.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 546.225 |
| USD | 2.165.350 | JPY | 283.300.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 129.342 |
| USD | 136.809.784 | JPY | 17.953.580.000 | Goldman Sachs | 21/6/2023 | 7.808.510 |
| USD | 3.550.153 | JPY | 468.480.000 | HSBC | 21/6/2023 | 185.272 |
| USD | 4.267.412 | JPY | 566.620.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 199.343 |
| USD | 5.998.525 | JPY | 836.000.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 15.630 |
| USD | 7.468.131 | NOK | 77.140.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 512.312 |
| USD | 10.221.079 | NOK | 106.900.000 | Barclays Bank | 21/6/2023 | 590.029 |
| USD | 18.042.889 | NOK | 189.250.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 995.948 |
| USD | 6.053.407 | NZD | 9.660.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 244.031 |
| USD | 6.055.116 | NZD | 9.660.000 | Citibank | 21/6/2023 | 245.630 |
| USD | 6.707.416 | NZD | 10.930.000 | HSBC | 21/6/2023 | 143.429 |
| USD | 10.164.821 | NZD | 16.230.000 | Morgan Stanley | 21/6/2023 | 404.712 |
| USD | 692.544 | SEK | 7.110.000 | Bank of America Merrill Lynch | 21/6/2023 | 35.315 |
| USD | 1.361.886 | SEK | 13.930.000 | BNP Paribas | 21/6/2023 | 73.909 |
| USD | 1.446.645 | SEK | 15.130.000 | Deutsche Bank | 21/6/2023 | 49.815 |
| USD | 35.198.456 | SEK | 374.530.000 | JP Morgan | 21/6/2023 | 660.608 |
| ZAR | 594.740.000 | EUR | 28.117.214 | Citibank | 2/6/2023 | 181.263 |
| | | | | | | (21.348.884) |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 81.256.781 | EUR | 82.917.821 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 527.357 |
| EUR | 2.107.257 | CHF | 2.048.581 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 3.505 |
| | | | | | | 530.862 |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 139.998 | GBP | 121.820 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.167) |
| GBP | 8.734.335 | EUR | 10.001.230 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 120.136 |
| | | | | | | 118.969 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) EUR |
|--|-------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 54 | JPY | 8.028 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| JPY | 557.597 | EUR | 3.749 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (19) |
| | | | | | | (19) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 5.337.484 | USD | 5.810.842 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (100.559) |
| USD | 162.010.746 | EUR | 146.376.335 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 5.240.467 |
| | | | | | | 5.139.908 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - EUR 6.518.310.384) | | | | | | (15.559.164) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|---------------------------------------|--------------|
| Finanzen | 32,85 |
| Staatsanleihen | 24,32 |
| Mit Hypotheken besicherte Wertpapiere | 11,24 |
| Versorger | 6,86 |
| Asset Backed Securities (ABS) | 3,87 |
| Kommunikation | 3,56 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 3,07 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 2,77 |
| Zyklische Konsumgüter | 2,62 |
| Industrie | 1,62 |
| Energie | 1,02 |
| Grundstoffe | 0,91 |
| Technologie | 0,60 |
| Börsengehandelte Fonds (ETF) | 0,47 |
| Diversifiziert | 0,00 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 95,78 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 4,22 |
| <hr/> | |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIE UND VORZUGSAKTIE | | | | | | | |
| Australien | | | | | | | |
| 79.308 | Aristocrat Leisure Ltd | 1.908.903 | 0,46 | 2.333 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 2.029.467 | 0,49 |
| 2.593 | CSL Ltd | 514.737 | 0,13 | 5.723 | Pernod Ricard SA | 1.230.090 | 0,30 |
| 53.724 | Fortescue Metals Group Ltd | 669.005 | 0,16 | 12.167 | Schneider Electric SE | 2.117.064 | 0,51 |
| 24.660 | Macquarie Group Ltd | 2.727.950 | 0,66 | 30.167 | Societe Generale SA | 699.780 | 0,17 |
| 105.257 | National Australia Bank Ltd | 1.771.050 | 0,43 | 10.765 | Valeo | 207.645 | 0,05 |
| 51.137 | Qantas Airways Ltd | 220.326 | 0,05 | | | | |
| 4.571 | Sims Ltd | 42.054 | 0,01 | | | | |
| 140.308 | Westpac Banking Corp | 1.879.927 | 0,46 | | | | |
| | | 9.733.952 | 2,36 | | | 13.239.490 | 3,22 |
| Österreich | | | | Deutschland | | | |
| 21.760 | ANDRITZ AG | 1.166.359 | 0,28 | 4.919 | Bayerische Motoren Werke AG | 539.512 | 0,13 |
| 2.296 | BAWAG Group AG | 99.827 | 0,03 | 902 | Bayerische Motoren Werke AG (Pref) (Pref) | 92.940 | 0,02 |
| 30.657 | Raiffeisen Bank International AG^ | 451.402 | 0,11 | 1.828 | Deutsche Telekom AG RegS^ | 40.930 | 0,01 |
| | | 1.717.588 | 0,42 | 14.734 | Freenet AG | 363.414 | 0,09 |
| Belgien | | | | | | | |
| 4.217 | Ackermans & van Haaren NV | 696.118 | 0,17 | 708 | GEA Group AG | 29.581 | 0,01 |
| 1.531 | Elia Group SA | 183.743 | 0,04 | 1.613 | Knorr-Bremse AG | 110.536 | 0,03 |
| 599 | Groupe Bruxelles Lambert NV | 46.395 | 0,01 | 41.996 | Mercedes-Benz Group AG | 3.150.544 | 0,77 |
| | | 926.256 | 0,22 | 357 | Merck KGaA^ | 62.133 | 0,01 |
| Kanada | | | | | | | |
| 16.996 | ARC Resources Ltd | 204.643 | 0,05 | 1.677 | Nemetschek SE^ | 131.575 | 0,03 |
| 1.478 | Bank of Nova Scotia | 71.879 | 0,02 | 26.095 | SAP SE | 3.404.293 | 0,83 |
| 6.623 | Birchcliff Energy Ltd^ | 36.955 | 0,01 | 7.676 | Scout24 SE | 488.976 | 0,12 |
| 43.833 | Crescent Point Energy Corp | 280.946 | 0,07 | 21.637 | Siemens AG Reg | 3.555.999 | 0,86 |
| 52.927 | Enbridge Inc | 1.871.029 | 0,45 | 108.403 | thyssenkrupp AG | 745.413 | 0,18 |
| 22.896 | Enerplus Corp | 317.036 | 0,08 | 1.278 | Wacker Chemie AG | 169.618 | 0,04 |
| 2.061 | FirstService Corp | 298.910 | 0,07 | | | | |
| 472 | Franco-Nevada Corp | 67.616 | 0,01 | | | | |
| 61.096 | Hydro One Ltd | 1.717.533 | 0,42 | | | | |
| 108.609 | Manulife Financial Corp | 2.013.419 | 0,49 | | | | |
| 31.173 | Stantec Inc | 1.803.939 | 0,44 | | | | |
| 13.667 | Tourmaline Oil Corp^ | 577.364 | 0,14 | | | | |
| 54.689 | Wheaton Precious Metals Corp | 2.418.354 | 0,59 | | | | |
| | | 11.679.623 | 2,84 | | | | |
| Kaimaninseln | | | | Hongkong | | | |
| 5.100 | Budweiser Brewing Co APAC Ltd | 12.812 | 0,00 | 206.800 | AIA Group Ltd | 1.982.484 | 0,48 |
| | | 12.812 | 0,00 | 158.500 | BOC Hong Kong Holdings Ltd | 470.404 | 0,11 |
| Curaçao | | | | | | | |
| 29.656 | Schlumberger NV | 1.282.622 | 0,31 | 11.000 | New World Development Co Ltd | 26.258 | 0,01 |
| | | 1.282.622 | 0,31 | 199.600 | Swire Properties Ltd | 475.435 | 0,12 |
| Dänemark | | | | | | | |
| 962 | Genmab A/S | 376.787 | 0,09 | | | 2.954.581 | 0,72 |
| 18.583 | Novo Nordisk A/S 'B' | 2.977.969 | 0,72 | Irland | | | |
| 46.623 | Novozymes A/S 'B'^ | 2.265.228 | 0,55 | 8.272 | Accenture Plc 'A' | 2.532.886 | 0,62 |
| | | 5.619.984 | 1,36 | 8.499 | Aon Plc 'A' | 2.614.122 | 0,64 |
| Finnland | | | | | | | |
| 1.713 | Sampo Oyj 'A' | 78.778 | 0,02 | 1.934 | Kingspan Group Plc (traded in Ireland) | 130.469 | 0,03 |
| | | 78.778 | 0,02 | 7.745 | Medtronic Plc | 636.484 | 0,15 |
| Frankreich | | | | | | | |
| 360 | Air Liquide SA | 60.265 | 0,02 | 807 | Trane Technologies Plc | 132.663 | 0,03 |
| 690 | Amundi SA | 38.753 | 0,01 | | | 6.046.624 | 1,47 |
| 19.081 | AXA SA | 543.775 | 0,13 | Italien | | | |
| 81.277 | Engie SA | 1.223.127 | 0,30 | 74.140 | A2A SpA | 122.188 | 0,03 |
| 632 | Hermes International | 1.290.387 | 0,31 | 44.964 | Enel SpA | 282.493 | 0,07 |
| 1.598 | Kering SA | 849.975 | 0,21 | 456.665 | Intesa Sanpaolo SpA | 1.058.344 | 0,26 |
| 6.912 | L'Oreal SA | 2.949.162 | 0,72 | 18 | Italgas SpA | 103 | 0,00 |
| | | | | 4.076 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | 44.718 | 0,01 |
| | | | | 680 | Moncler SpA | 45.989 | 0,01 |
| | | | | 20.254 | Terna - Rete Elettrica Nazionale | 169.809 | 0,04 |
| | | | | 23.465 | UniCredit SpA^ | 454.794 | 0,11 |
| | | | | | | 2.178.438 | 0,53 |
| | | | | Japan | | | |
| | | | | 134.100 | Amada Co Ltd | 1.275.320 | 0,31 |
| | | | | 115.600 | Astellas Pharma Inc | 1.820.619 | 0,44 |
| | | | | 4.400 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | 48.563 | 0,01 |
| | | | | 1.400 | COMSYS Holdings Corp | 27.018 | 0,01 |
| | | | | 1.200 | Daito Trust Construction Co Ltd | 113.438 | 0,03 |
| | | | | 11.500 | Daiwa House Industry Co Ltd | 298.812 | 0,07 |
| | | | | 1.300 | Disco Corp | 188.742 | 0,05 |
| | | | | 2.000 | Dowa Holdings Co Ltd | 57.718 | 0,01 |
| | | | | 3.400 | Fast Retailing Co Ltd | 792.723 | 0,19 |
| | | | | 5.000 | Hitachi Ltd | 287.019 | 0,07 |
| | | | | 14.600 | JGC Holdings Corp | 176.973 | 0,04 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------------------------|--|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 23.484 | 3M Co | 2.219.708 | 0,54 | 4.964 | General Electric Co [^] | 499.974 | 0,12 |
| 22.854 | Abbott Laboratories | 2.307.797 | 0,56 | 22.210 | General Mills Inc | 1.852.536 | 0,45 |
| 11.936 | AbbVie Inc | 1.622.938 | 0,39 | 61.828 | General Motors Co | 2.016.211 | 0,49 |
| 10.511 | Adobe Inc | 4.365.218 | 1,06 | 11.648 | Gilead Sciences Inc | 891.771 | 0,22 |
| 34.163 | AECOM | 2.646.266 | 0,64 | 398 | Graco Inc | 30.300 | 0,01 |
| 23.882 | Agilent Technologies Inc | 2.756.222 | 0,67 | 660 | Helmerich & Payne Inc | 21.127 | 0,01 |
| 430 | Align Technology Inc | 119.944 | 0,03 | 3.615 | Hershey Co | 930.790 | 0,23 |
| 8.887 | Allstate Corp | 976.059 | 0,24 | 67.470 | Hewlett Packard Enterprise Co | 977.978 | 0,24 |
| 53.652 | Alphabet Inc 'A' | 6.606.171 | 1,60 | 13.490 | Home Depot Inc | 3.853.014 | 0,94 |
| 49.635 | Alphabet Inc 'C' | 6.154.244 | 1,49 | 68.117 | HP Inc | 2.026.481 | 0,49 |
| 61.724 | Amazon.com Inc | 7.516.749 | 1,83 | 229 | IDEXX Laboratories Inc | 105.361 | 0,03 |
| 21.580 | American Express Co | 3.419.351 | 0,83 | 4.607 | Illinois Tool Works Inc [^] | 1.011.144 | 0,25 |
| 869 | American Financial Group Inc | 98.892 | 0,02 | 4.537 | Incyte Corp | 280.976 | 0,07 |
| 4.932 | AMETEK Inc | 719.924 | 0,17 | 275 | Insperity Inc | 30.107 | 0,01 |
| 4.831 | Amgen Inc | 1.055.718 | 0,26 | 39.288 | Intel Corp | 1.191.605 | 0,29 |
| 5.241 | Analog Devices Inc | 933.003 | 0,23 | 1.010 | Intuitive Surgical Inc | 305.262 | 0,07 |
| 133.610 | Apple Inc | 23.904.833 | 5,81 | 22.049 | Johnson & Johnson | 3.396.869 | 0,82 |
| 29.663 | Applied Materials Inc | 3.993.530 | 0,97 | 2.214 | Jones Lang LaSalle Inc [^] | 312.794 | 0,08 |
| 707 | Archer-Daniels-Midland Co | 49.999 | 0,01 | 4.643 | JPMorgan Chase & Co | 628.059 | 0,15 |
| 28.135 | AT&T Inc | 442.282 | 0,11 | 27.778 | Juniper Networks Inc | 845.007 | 0,21 |
| 2.817 | Autodesk Inc | 556.160 | 0,14 | 18.966 | Kellogg Co | 1.250.239 | 0,30 |
| 283 | Automatic Data Processing Inc | 58.655 | 0,01 | 2.917 | KeyCorp | 28.207 | 0,01 |
| 1.819 | Axon Enterprise Inc | 349.121 | 0,08 | 7.613 | Keysight Technologies Inc | 1.239.473 | 0,30 |
| 103.237 | Bank of America Corp | 2.882.893 | 0,70 | 1.377 | KLA Corp | 620.958 | 0,15 |
| 17.336 | Bank of New York Mellon Corp | 700.201 | 0,17 | 1.350 | Lam Research Corp | 845.316 | 0,21 |
| 7.288 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | 2.334.055 | 0,57 | 4.885 | Lear Corp | 602.272 | 0,15 |
| 31.941 | Best Buy Co Inc | 2.324.027 | 0,56 | 473 | Lennox International Inc [^] | 131.693 | 0,03 |
| 998 | Biogen Inc | 296.206 | 0,07 | 4.256 | Lowe's Cos Inc | 860.606 | 0,21 |
| 17.018 | Block Inc | 1.040.480 | 0,25 | 7.629 | Lululemon Athletica Inc | 2.528.403 | 0,61 |
| 17.916 | BorgWarner Inc | 802.637 | 0,19 | 10.859 | Manhattan Associates Inc | 1.968.194 | 0,48 |
| 61.961 | Boston Scientific Corp | 3.135.846 | 0,76 | 7.535 | ManpowerGroup Inc | 524.436 | 0,13 |
| 4.176 | Brighthouse Financial Inc | 168.752 | 0,04 | 13.670 | Marathon Oil Corp | 305.388 | 0,07 |
| 56.074 | Bristol-Myers Squibb Co | 3.574.157 | 0,87 | 4.755 | Marathon Petroleum Corp | 500.749 | 0,12 |
| 9.730 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | 191.681 | 0,05 | 6.582 | Marsh & McLennan Cos Inc | 1.134.605 | 0,28 |
| 171 | Cadence Design Systems Inc | 39.899 | 0,01 | 12.747 | Mastercard Inc 'A' | 4.588.538 | 1,11 |
| 5.084 | Caterpillar Inc | 1.053.151 | 0,26 | 5.293 | McDonald's Corp | 1.503.847 | 0,37 |
| 21.562 | Chevron Corp | 3.277.208 | 0,80 | 635 | McKesson Corp | 244.215 | 0,06 |
| 12.732 | Cigna Group | 3.101.642 | 0,75 | 211 | MercadoLibre Inc | 261.815 | 0,06 |
| 460 | Cintas Corp | 215.970 | 0,05 | 28.957 | Merck & Co Inc | 3.161.525 | 0,77 |
| 34.184 | Cisco Systems Inc | 1.705.098 | 0,41 | 16.992 | Meta Platforms Inc 'A' | 4.455.642 | 1,08 |
| 10.024 | Citigroup Inc | 441.557 | 0,11 | 57.174 | MetLife Inc | 2.876.996 | 0,70 |
| 70.751 | Coca-Cola Co | 4.204.732 | 1,02 | 75 | Mettler-Toledo International Inc | 97.643 | 0,02 |
| 34.134 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | 2.136.276 | 0,52 | 1.545 | MGM Resorts International | 60.533 | 0,01 |
| 12.674 | Colgate-Palmolive Co | 944.213 | 0,23 | 61.831 | Microsoft Corp | 20.701.019 | 5,03 |
| 19.980 | Comcast Corp 'A' [^] | 783.616 | 0,19 | 896 | Moderna Inc [^] | 114.948 | 0,03 |
| 18.923 | ConocoPhillips | 1.898.545 | 0,46 | 900 | Moody's Corp | 281.097 | 0,07 |
| 429 | Consolidated Edison Inc | 39.730 | 0,01 | 2.596 | Neurocrine Biosciences Inc | 235.613 | 0,06 |
| 2.531 | Costco Wholesale Corp | 1.280.635 | 0,31 | 11.513 | Newmont Corp | 462.017 | 0,11 |
| 128 | Cummins Inc | 26.136 | 0,01 | 6.796 | NextEra Energy Inc | 490.603 | 0,12 |
| 48.622 | CVS Health Corp | 3.256.702 | 0,79 | 916 | Norfolk Southern Corp | 190.409 | 0,05 |
| 3.284 | Danaher Corp | 738.013 | 0,18 | 27.586 | NVIDIA Corp | 10.948.332 | 2,66 |
| 3.000 | Darden Restaurants Inc | 478.080 | 0,12 | 35.451 | Otis Worldwide Corp | 2.832.180 | 0,69 |
| 3.359 | Deere & Co | 1.170.208 | 0,28 | 2.933 | Owens Corning | 315.796 | 0,08 |
| 29.142 | Dell Technologies Inc 'C' | 1.341.406 | 0,33 | 5.577 | Paychex Inc | 590.604 | 0,14 |
| 740 | Domino's Pizza Inc | 216.036 | 0,05 | 16.047 | PayPal Holdings Inc | 1.007.912 | 0,24 |
| 15.456 | DuPont de Nemours Inc [^] | 1.046.062 | 0,25 | 23.485 | PepsiCo Inc | 4.278.967 | 1,04 |
| 64.738 | eBay Inc | 2.766.255 | 0,67 | 46.301 | Pfizer Inc | 1.721.934 | 0,42 |
| 24.070 | Edison International | 1.598.489 | 0,39 | 422 | Power Integrations Inc | 37.005 | 0,01 |
| 4.164 | Edwards Lifesciences Corp | 339.491 | 0,08 | 3.075 | Procter & Gamble Co | 436.804 | 0,11 |
| 6.192 | Elevance Health Inc | 2.753.025 | 0,67 | 2.642 | Prudential Financial Inc | 209.880 | 0,05 |
| 804 | Eli Lilly & Co | 341.467 | 0,08 | 1.858 | Public Service Enterprise Group Inc | 110.291 | 0,03 |
| 9.976 | EOG Resources Inc | 1.072.619 | 0,26 | 5.675 | QUALCOMM Inc | 644.112 | 0,16 |
| 6.398 | Etsy Inc | 528.027 | 0,13 | 1.879 | Ralph Lauren Corp | 200.020 | 0,05 |
| 34.511 | Exxon Mobil Corp | 3.540.829 | 0,86 | 824 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 603.044 | 0,15 |
| 1.438 | FMC Corp | 148.905 | 0,04 | 472 | Reliance Steel & Aluminum Co [^] | 110.000 | 0,03 |
| 99.926 | Ford Motor Co [^] | 1.225.093 | 0,30 | 3.275 | Robert Half International Inc | 215.200 | 0,05 |
| 2.098 | Fortinet Inc | 144.028 | 0,03 | 9.937 | S&P Global Inc | 3.595.803 | 0,87 |
| 68.482 | Fox Corp 'A' | 2.147.595 | 0,52 | 6.606 | Salesforce Inc [^] | 1.455.830 | 0,35 |
| 32.158 | Fox Corp 'B' | 939.014 | 0,23 | 1.825 | SBA Communications Corp (REIT) | 402.485 | 0,10 |
| 6.142 | Gartner Inc | 2.115.059 | 0,51 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--|--|------------------------|--------------------|------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | Brasilien Fortsetzung | | | |
| STAMMAKTIE UND VORZUGSAKTIE | | | | | | | |
| Australien | | | | | | | |
| 3.053 | Aristocrat Leisure Ltd | 73.484 | 0,05 | 3.216 | Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA | 2.807 | 0,00 |
| 6.390 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd* | 94.891 | 0,07 | 4.182 | Sao Martinho S/A | 29.994 | 0,02 |
| 6.057 | Bank of Queensland Ltd* | 21.466 | 0,01 | 6.896 | Sendas Distribuidora S/A | 15.028 | 0,01 |
| 59.266 | BHP Group Ltd | 1.613.503 | 1,15 | 2.209 | Telefonica Brasil SA | 17.824 | 0,01 |
| 1.494 | Charter Hall Group (REIT) | 10.841 | 0,01 | 4.011 | Ultrapar Participacoes SA | 13.293 | 0,01 |
| 267 | Commonwealth Bank of Australia | 16.742 | 0,01 | 105.851 | Usinas Siderurgicas de Minas Gerais S/A Usiminas 'A' (Pref) (Pref) | 146.831 | 0,11 |
| 775 | CSL Ltd | 153.845 | 0,11 | 15.065 | Vale SA | 190.303 | 0,14 |
| 7.645 | Fortescue Metals Group Ltd | 95.200 | 0,07 | 2.684 | YDUQS Participacoes SA | 7.430 | 0,01 |
| 4.097 | GPT Group (REIT) | 11.122 | 0,01 | | | 1.494.880 | 1,07 |
| 4.181 | Lottery Corp Ltd | 13.490 | 0,01 | Kanada | | | |
| 7.442 | Macquarie Group Ltd | 823.252 | 0,59 | 2.774 | Agnico Eagle Mines Ltd* | 138.939 | 0,10 |
| 31.717 | National Australia Bank Ltd* | 533.669 | 0,38 | 37.027 | Alamos Gold Inc 'A' | 449.908 | 0,32 |
| 3.031 | Newcrest Mining Ltd | 50.450 | 0,03 | 1.926 | Alimentation Couche-Tard Inc | 91.871 | 0,07 |
| 2.913 | Qantas Airways Ltd | 12.551 | 0,01 | 14.561 | Barrick Gold Corp* | 244.919 | 0,17 |
| 1.199 | Rio Tinto Ltd | 83.121 | 0,06 | 2.312 | Canadian National Railway Co | 261.287 | 0,19 |
| 1.139 | Transurban Group (Unit) | 10.951 | 0,01 | 6.657 | Canadian Natural Resources Ltd | 358.106 | 0,26 |
| 56.937 | Westpac Banking Corp | 762.875 | 0,54 | 664 | Capital Power Corp | 21.972 | 0,02 |
| | | 4.381.453 | 3,12 | 27.391 | Crescent Point Energy Corp | 175.561 | 0,13 |
| | | | | 7.698 | Enbridge Inc | 272.133 | 0,19 |
| Österreich | | | | 49 | Fairfax Financial Holdings Ltd | 34.870 | 0,02 |
| 3.287 | ANDRITZ AG | 176.187 | 0,13 | 1.146 | FirstService Corp | 166.206 | 0,12 |
| 12.346 | Raiffeisen Bank International AG* | 181.786 | 0,13 | 3.156 | Franco-Nevada Corp | 452.112 | 0,32 |
| | | 357.973 | 0,26 | 5.686 | Imperial Oil Ltd* | 258.365 | 0,18 |
| Belgien | | | | 19.734 | Kinross Gold Corp | 92.002 | 0,07 |
| 333 | Ageas SA | 13.412 | 0,01 | 5.340 | Manulife Financial Corp | 98.994 | 0,07 |
| 1.983 | Groupe Bruxelles Lambert NV | 153.592 | 0,11 | 8.599 | Pan American Silver Corp | 128.160 | 0,09 |
| 8.198 | Solvay SA* | 849.081 | 0,60 | 988 | Royal Bank of Canada | 88.982 | 0,06 |
| | | 1.016.085 | 0,72 | 4.755 | Stantec Inc | 275.165 | 0,20 |
| | | | | 2.340 | Teck Resources Ltd 'B' | 90.332 | 0,06 |
| Bermuda | | | | 135 | West Fraser Timber Co Ltd | 9.347 | 0,01 |
| 45 | Everest Re Group Ltd | 15.770 | 0,01 | 1.972 | Wheaton Precious Metals Corp | 87.202 | 0,06 |
| 1.686 | Genpact Ltd | 61.809 | 0,05 | | | 3.796.433 | 2,71 |
| 4.400 | Jardine Matheson Holdings Ltd | 211.244 | 0,15 | Kaimaninseln | | | |
| 1.500 | Orient Overseas International Ltd | 18.276 | 0,01 | 66.000 | 3SBio Inc | 66.725 | 0,05 |
| | | 307.099 | 0,22 | 45.912 | Alibaba Group Holding Ltd | 456.544 | 0,32 |
| Brasilien | | | | 2.400 | ANTA Sports Products Ltd | 24.493 | 0,02 |
| 90.147 | Ambev SA | 255.069 | 0,18 | 1.805 | Autohome Inc ADR | 50.558 | 0,04 |
| 47.781 | Azul SA (Pref) (Pref) | 153.554 | 0,11 | 17.034 | Baidu Inc 'A' | 259.621 | 0,18 |
| 19.940 | Banco Bradesco SA (Pref) (Pref) | 61.606 | 0,04 | 600 | BeiGene Ltd | 10.202 | 0,01 |
| 5.281 | Banco do Brasil SA | 46.513 | 0,03 | 50.500 | China Hongqiao Group Ltd | 35.841 | 0,02 |
| 21.187 | Cia de Saneamento de Minas Gerais Copasa MG | 82.950 | 0,06 | 12.500 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | 6.590 | 0,00 |
| 8.831 | Cia Energetica de Minas Gerais (Pref) (Pref) | 20.550 | 0,02 | 10.000 | CIMC Enric Holdings Ltd | 8.233 | 0,01 |
| 106.328 | Cia Paranaense de Energia (Pref) (Pref) | 157.549 | 0,11 | 16.000 | CK Asset Holdings Ltd | 86.189 | 0,06 |
| 32.291 | Cielo SA | 29.904 | 0,02 | 40.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | 244.790 | 0,17 |
| 69.568 | Cogna Educacao SA | 39.615 | 0,03 | 3.300 | ENN Energy Holdings Ltd | 38.333 | 0,03 |
| 5.353 | CPFL Energia SA | 32.476 | 0,02 | 58.000 | Geely Automobile Holdings Ltd | 67.448 | 0,05 |
| 21.212 | CSN Mineracao SA | 18.474 | 0,01 | 6.500 | Innovent Biologics Inc | 30.451 | 0,02 |
| 14.092 | CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA | 8.469 | 0,01 | 6.200 | JD Logistics Inc | 9.909 | 0,01 |
| 8.770 | Dexco SA | 15.120 | 0,01 | 6.450 | JD.com Inc 'A' | 103.658 | 0,07 |
| 8.928 | Embraer SA | 33.477 | 0,02 | 1.000 | Jinan Acetate Chemical Co Ltd | 17.151 | 0,01 |
| 4.147 | Fleury SA | 12.763 | 0,01 | 1.560 | Meituan 'B' | 21.945 | 0,02 |
| 11.805 | Gerdau SA (Pref) (Pref) | 55.988 | 0,04 | 2.565 | NetEase Inc | 43.416 | 0,03 |
| 4.043 | Iochepe Maxion SA | 9.918 | 0,01 | 2.537 | NU Holdings Ltd 'A' | 17.074 | 0,01 |
| 13.785 | Natura & Co Holding SA | 37.375 | 0,03 | 926 | Pagseguro Digital Ltd 'A' | 9.204 | 0,01 |
| | | | | 3.669 | StoneCo Ltd 'A' | 45.679 | 0,03 |
| | | | | 584 | Tecnoglass Inc* | 22.490 | 0,02 |
| | | | | 28.900 | Tencent Holdings Ltd | 1.145.826 | 0,82 |
| | | | | 5.999 | Vipshop Holdings Ltd ADR | 84.346 | 0,06 |
| | | | | | | 2.906.716 | 2,07 |
| | | | | China | | | |
| | | | | 20.000 | Aluminum Corp of China Ltd 'H' | 8.833 | 0,01 |
| | | | | 890 | Bloomage Biotechnology Corp Ltd 'A' | 10.996 | 0,01 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|--------------------------|---|------------------------|--------------------|-------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| China Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| 16.576 | BYD Co Ltd 'A' | 589.727 | 0,42 | 43.987 | Engie SA [^] | 661.954 | 0,47 |
| 3.000 | BYD Co Ltd 'H' | 90.529 | 0,06 | 287 | Hermes International | 585.983 | 0,42 |
| 3.500 | China Merchants Bank Co Ltd 'A' | 15.856 | 0,01 | 1.699 | Legrand SA | 160.875 | 0,11 |
| 38.000 | China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H' | 14.358 | 0,01 | 1.690 | L'Oreal SA | 721.077 | 0,51 |
| 63.000 | CMOC Group Ltd 'H' | 32.891 | 0,02 | 499 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 434.078 | 0,31 |
| 13.240 | Contemporary Ampere Technology Co Ltd 'A' | 410.709 | 0,29 | 1.168 | Pernod Ricard SA [^] | 251.048 | 0,18 |
| 10.000 | Great Wall Motor Co Ltd 'H' | 10.263 | 0,01 | 8.652 | Rexel SA | 176.264 | 0,13 |
| 1.000 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | 7.493 | 0,01 | 2.836 | Sanofi | 287.189 | 0,20 |
| 4.060 | JA Solar Technology Co Ltd 'A' | 20.500 | 0,02 | 1.595 | Schneider Electric SE | 277.531 | 0,20 |
| 1.680 | Joinn Laboratories China Co Ltd 'H' | 6.069 | 0,00 | 7.699 | Societe Generale SA | 178.593 | 0,13 |
| 29.300 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 118.435 | 0,08 | 869 | Thales SA | 121.969 | 0,09 |
| 720 | Ningbo Deye Technology Co Ltd 'A' | 13.677 | 0,01 | 4.204 | Veolia Environnement SA [^] | 125.597 | 0,09 |
| 6.700 | Ping An Bank Co Ltd 'A' | 10.901 | 0,01 | | | 4.266.809 | 3,04 |
| 23.500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 149.088 | 0,11 | Deutschland | | | |
| 14.900 | Seazen Holdings Co Ltd 'A' | 29.215 | 0,02 | 241 | Bayerische Motoren Werke AG | 26.433 | 0,02 |
| 4.400 | SF Holding Co Ltd 'A' | 29.208 | 0,02 | 134 | Bayerische Motoren Werke AG (Pref) (Pref) | 13.807 | 0,01 |
| 8.200 | Shandong Gold Mining Co Ltd 'A' | 29.040 | 0,02 | 1.540 | Beiersdorf AG | 197.402 | 0,14 |
| 60.700 | Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd 'A' | 25.626 | 0,02 | 1.388 | Covestro AG | 54.094 | 0,04 |
| 8.900 | Shanghai International Airport Co Ltd 'A' | 58.170 | 0,04 | 707 | Daimler Truck Holding AG | 21.447 | 0,01 |
| 2.200 | Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'H' | 7.175 | 0,01 | 11.893 | E.ON SE | 144.067 | 0,10 |
| 25.955 | Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd 'A' | 129.305 | 0,09 | 1.904 | Evonik Industries AG | 38.302 | 0,03 |
| 2.400 | Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd 'A' | 70.632 | 0,05 | 2.885 | Freenet AG | 71.158 | 0,05 |
| 2.800 | Shenzhen Kstar Science And Technology Co Ltd 'A' | 15.210 | 0,01 | 303 | FUCHS PETROLUB SE (Pref) | 10.780 | 0,01 |
| 5.900 | Shenzhen SC New Energy Technology Corp 'A' | 79.134 | 0,06 | 307 | GEA Group AG | 12.827 | 0,01 |
| 6.900 | Sunwoda Electronic Co Ltd 'A' | 15.407 | 0,01 | 15.110 | Mercedes-Benz Group AG | 1.133.554 | 0,81 |
| 640 | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd 'A' | 14.183 | 0,01 | 1.638 | SAP SE | 213.690 | 0,15 |
| 1.200 | Tianqi Lithium Corp 'H' | 7.774 | 0,01 | 10.173 | Siemens AG Reg | 1.671.913 | 1,19 |
| 1.100 | Wanhua Chemical Group Co Ltd 'A' | 12.691 | 0,01 | 107 | Volkswagen AG [^] | 16.377 | 0,01 |
| 7.520 | Weihai Guangwei Composites Co Ltd 'A' | 30.893 | 0,02 | | | 3.625.851 | 2,58 |
| 9.340 | WuXi AppTec Co Ltd 'H' | 76.900 | 0,06 | Hongkong | | | |
| 1.600 | Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd 'A' | 15.473 | 0,01 | 47.200 | AIA Group Ltd | 452.482 | 0,32 |
| 32.100 | Zijin Mining Group Co Ltd 'A' | 48.129 | 0,03 | 32.500 | BOC Hong Kong Holdings Ltd | 96.455 | 0,07 |
| 46.000 | Zijin Mining Group Co Ltd 'H' | 62.359 | 0,04 | 10.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | 8.706 | 0,01 |
| | | 2.266.849 | 1,62 | 27.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd | 167.329 | 0,12 |
| Curaçao | | | | 831 | I-CABLE Communications Ltd | 5 | 0,00 |
| 22.244 | Schlumberger NV | 962.053 | 0,69 | 126.000 | Lenovo Group Ltd | 118.377 | 0,08 |
| | | 962.053 | 0,69 | 34.000 | New World Development Co Ltd | 81.160 | 0,06 |
| Dänemark | | | | 5.000 | Swire Properties Ltd | 11.910 | 0,01 |
| 314 | Genmab A/S | 122.985 | 0,09 | | | 936.424 | 0,67 |
| 6.244 | Novo Nordisk A/S 'B' | 1.000.615 | 0,71 | Ungarn | | | |
| 5.481 | Novozymes A/S 'B' | 266.300 | 0,19 | 4.809 | MOL Hungarian Oil & Gas Plc | 40.292 | 0,03 |
| | | 1.389.900 | 0,99 | 929 | OTP Bank Nyrt | 29.002 | 0,02 |
| Frankreich | | | | | | 69.294 | 0,05 |
| 152 | Arkema SA | 13.068 | 0,01 | Indien | | | |
| 5.142 | Bureau Veritas SA | 131.769 | 0,09 | 867 | ABB India Ltd | 45.009 | 0,03 |
| 539 | Capgemini SE | 94.672 | 0,07 | 2.797 | Adani Power Ltd | 8.474 | 0,01 |
| 3 | Casino Guichard Perrachon SA [^] | 18 | 0,00 | 1.058 | Adani Transmission Ltd | 10.333 | 0,01 |
| 262 | Dassault Aviation SA | 45.124 | 0,03 | 548 | Amara Raja Batteries Ltd | 3.968 | 0,00 |
| | | | | 1.166 | APL Apollo Tubes Ltd | 15.898 | 0,01 |
| | | | | 1.661 | Asian Paints Ltd | 64.146 | 0,05 |
| | | | | 1.289 | Astral Ltd | 28.247 | 0,02 |
| | | | | 694 | Avenue Supermarts Ltd | 28.974 | 0,02 |
| | | | | 1.819 | Bajaj Finance Ltd | 153.359 | 0,11 |
| | | | | 960 | Bajaj Finserv Ltd | 16.825 | 0,01 |
| | | | | 13.383 | Birlasoft Ltd | 55.728 | 0,04 |
| | | | | 4.906 | CG Power & Industrial Solutions Ltd | 23.127 | 0,02 |
| | | | | 1.155 | Coromandel International Ltd | 13.430 | 0,01 |
| | | | | 392 | Dalmia Bharat Ltd | 10.116 | 0,01 |
| | | | | 2.731 | Delta Corp Ltd | 7.998 | 0,00 |
| | | | | 3.317 | Firstsource Solutions Ltd | 5.395 | 0,00 |
| | | | | 841 | Godrej Properties Ltd | 14.181 | 0,01 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|----------------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------|------------------------------|--|------------------------|--------------------|
| Luxemburg | | | | Südafrika Fortsetzung | | | |
| 22.932 | ArcelorMittal SA | 571.127 | 0,41 | 13.138 | Foschini Group Ltd | 56.148 | 0,04 |
| 3.582 | Tenaris SA | 44.902 | 0,03 | 571 | Gold Fields Ltd | 8.659 | 0,01 |
| | | 616.029 | 0,44 | 14.097 | Standard Bank Group Ltd | 108.375 | 0,08 |
| Malaysia | | | | 6.656 | Truworths International Ltd | 16.238 | 0,01 |
| 28.000 | CIMB Group Holdings Bhd | 29.241 | 0,02 | 9.826 | Woolworths Holdings Ltd | 29.518 | 0,02 |
| 56.900 | Dialog Group Bhd | 26.629 | 0,02 | | | 269.216 | 0,19 |
| 5.500 | Hong Leong Bank Bhd | 23.070 | 0,02 | Südkorea | | | |
| 80.100 | IHH Healthcare Bhd | 100.136 | 0,07 | 480 | Celltrion Inc | 61.951 | 0,04 |
| 26.800 | Inari Amertron Bhd | 14.632 | 0,01 | 160 | CJ ENM Co Ltd | 9.162 | 0,01 |
| 61.700 | Maxis Bhd | 54.942 | 0,04 | 1.639 | CJ Logistics Corp | 100.643 | 0,07 |
| 24.300 | MISC Bhd | 38.434 | 0,03 | 989 | GS Engineering & Construction Corp | 15.462 | 0,01 |
| 2.500 | Petronas Chemicals Group Bhd | 3.553 | 0,00 | 216 | HL Mando Co Ltd | 7.844 | 0,01 |
| 108.100 | Press Metal Aluminium Holdings Bhd | 107.971 | 0,08 | 309 | Hugel Inc | 25.330 | 0,02 |
| 54.600 | Public Bank Bhd | 45.071 | 0,03 | 51 | Hyundai Mobis Co Ltd | 8.569 | 0,01 |
| 88.200 | RHB Bank Bhd | 102.236 | 0,07 | 844 | Hyundai Steel Co | 20.730 | 0,01 |
| 28.200 | Sime Darby Bhd | 12.647 | 0,01 | 139 | KCC Corp | 21.836 | 0,02 |
| | | 558.562 | 0,40 | 2.164 | Kia Corp | 140.055 | 0,10 |
| Mexiko | | | | 320 | Kolon Industries Inc | 10.319 | 0,01 |
| 5.397 | Alsea SAB de CV | 15.193 | 0,01 | 1.813 | Korea Gas Corp | 35.857 | 0,02 |
| 4.144 | Arca Continental SAB de CV | 41.273 | 0,03 | 13 | LG H&H Co Ltd | 5.162 | 0,00 |
| 18.877 | Grupo Bimbo SAB de CV 'A' | 99.122 | 0,07 | 430 | NAVER Corp | 64.633 | 0,05 |
| 10.409 | Grupo Mexico SAB de CV 'B' | 45.846 | 0,03 | 451 | POSCO Holdings Inc | 122.328 | 0,09 |
| | | 201.434 | 0,14 | 695 | Samsung Engineering Co Ltd | 14.819 | 0,01 |
| | | | | 228 | SK Hynix Inc | 18.656 | 0,01 |
| | | | | | | 683.356 | 0,49 |
| Niederlande | | | | Spanien | | | |
| 1.057 | ASML Holding NV | 763.957 | 0,54 | 14.119 | Acerinox SA | 143.821 | 0,10 |
| 3.562 | ASR Nederland NV* | 151.829 | 0,11 | 147.772 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 972.893 | 0,69 |
| 1.241 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | 39.222 | 0,03 | 25.522 | Banco de Sabadell SA | 25.175 | 0,02 |
| 3.535 | Wolters Kluwer NV | 405.570 | 0,29 | 5.333 | Bankinter SA | 30.909 | 0,02 |
| | | 1.360.578 | 0,97 | 17.068 | CaixaBank SA | 63.056 | 0,05 |
| Norwegen | | | | 2.578 | EDP Renovaveis SA | 51.323 | 0,04 |
| 960 | Aker BP ASA | 20.831 | 0,01 | 18.157 | Industria de Diseno Textil SA | 607.593 | 0,43 |
| | | 20.831 | 0,01 | 44.546 | Repsol SA | 601.922 | 0,43 |
| | | | | | | 2.496.692 | 1,78 |
| Polen | | | | Schweden | | | |
| 579 | Bank Polska Kasa Opieki SA | 13.231 | 0,01 | 1.829 | Assa Abloy AB 'B' | 40.872 | 0,03 |
| 1.350 | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA | 19.152 | 0,01 | 190 | Saab AB 'B' | 10.485 | 0,01 |
| | | 32.383 | 0,02 | | | 51.357 | 0,04 |
| Portugal | | | | Schweiz | | | |
| 20.683 | EDP - Energias de Portugal SA | 100.616 | 0,07 | 276 | ABB Ltd Reg | 10.191 | 0,01 |
| 1.152 | Jeronimo Martins SGPS SA | 28.020 | 0,02 | 3.206 | Chubb Ltd | 603.433 | 0,43 |
| | | 128.636 | 0,09 | 2.254 | Clariant AG Reg | 32.354 | 0,02 |
| Russland | | | | 1.556 | Garmin Ltd | 163.660 | 0,12 |
| 7.513 | Alrosa PJSC† | 1 | 0,00 | 36 | Givaudan SA Reg† | 119.639 | 0,08 |
| 11.202 | Gazprom PJSC† | 1 | 0,00 | 1.355 | Holcim AG | 83.410 | 0,06 |
| 1.201 | Lukoil OAO† | — | 0,00 | 7.140 | Nestle SA Reg | 852.435 | 0,61 |
| 181 | MMC Norilsk Nickel PJSC† | — | 0,00 | 8.726 | Novartis AG Reg† | 839.757 | 0,60 |
| 1.300 | Novatek PJSC† | — | 0,00 | 8 | Roche Holding AG | 2.738 | 0,00 |
| 4.078 | Tatneft PJSC† | 1 | 0,00 | 843 | TE Connectivity Ltd | 103.200 | 0,07 |
| | | 3 | 0,00 | | | 2.810.817 | 2,00 |
| Saudi-Arabien | | | | Taiwan | | | |
| 1.315 | ACWA Power Co | 52.308 | 0,04 | 3.000 | Chroma ATE Inc | 22.748 | 0,02 |
| 682 | Saudi Arabian Mining Co | 11.292 | 0,01 | 8.000 | Delta Electronics Inc | 82.402 | 0,06 |
| | | 63.600 | 0,05 | 2.000 | Global Unichip Corp | 97.307 | 0,07 |
| Singapur | | | | 15.000 | MediaTek Inc | 370.515 | 0,26 |
| 13.600 | ComfortDelGro Corp Ltd | 11.051 | 0,01 | 1.560 | momo.com Inc | 35.487 | 0,03 |
| 76.200 | Singapore Airlines Ltd† | 360.793 | 0,25 | 7.000 | Primax Electronics Ltd | 14.716 | 0,01 |
| | | 371.844 | 0,26 | 4.000 | Quanta Computer Inc | 15.166 | 0,01 |
| Südafrika | | | | 17.000 | Realtek Semiconductor Corp | 211.342 | 0,15 |
| 1.031 | AVI Ltd | 3.317 | 0,00 | 3.000 | Sino-American Silicon Products Inc | 15.524 | 0,01 |
| 15.281 | FirstRand Ltd | 46.961 | 0,03 | 30.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 544.789 | 0,39 |
| | | | | 10 | Tung Ho Steel Enterprise Corp | 18 | 0,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|---|------------------------|--------------------|
| Taiwan Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 15.000 | United Microelectronics Corp | 25.287 | 0,02 | 594 | Boeing Co | 119.887 | 0,09 |
| 15.000 | Wistron Corp | 32.560 | 0,02 | 15.813 | Boston Scientific Corp | 800.296 | 0,57 |
| 5.000 | Wistron NeWeb Corp | 14.238 | 0,01 | 661 | Boyd Gaming Corp | 42.043 | 0,03 |
| | | 1.482.099 | 1,06 | 1.325 | Brighthouse Financial Inc | 53.543 | 0,04 |
| Thailand | | | | 25.229 | Bristol-Myers Squibb Co | 1.608.096 | 1,15 |
| 54.800 | Airports of Thailand PCL NVDR | 111.411 | 0,08 | 335 | Carlisle Cos Inc | 71.539 | 0,05 |
| 18.900 | Energy Absolute PCL NVDR | 35.302 | 0,03 | 676 | Caterpillar Inc | 140.033 | 0,10 |
| 4.700 | JMT Network Services PCL | 5.807 | 0,00 | 44 | Chemed Corp | 23.257 | 0,02 |
| 22.100 | Precious Shipping PCL NVDR [^] | 5.938 | 0,00 | 975 | Cheniere Energy Inc | 133.458 | 0,10 |
| 7.100 | PTT Exploration & Production PCL NVDR [^] | 28.461 | 0,02 | 12.821 | Chevron Corp | 1.948.664 | 1,39 |
| | | 186.919 | 0,13 | 1.649 | Cigna Group | 401.713 | 0,29 |
| Türkei | | | | 1.285 | Cintas Corp | 603.308 | 0,43 |
| 3.845 | Arcelik AS [^] | 18.017 | 0,01 | 599 | Cisco Systems Inc | 29.878 | 0,02 |
| 23.275 | Enerjisa Enerji AS | 34.496 | 0,03 | 7.146 | Citigroup Inc | 314.781 | 0,22 |
| 34.147 | KOC Holding AS [^] | 131.471 | 0,09 | 23.235 | Coca-Cola Co | 1.380.856 | 0,98 |
| 3.944 | Migros Ticaret AS | 32.637 | 0,02 | 9.537 | ConocoPhillips | 956.847 | 0,68 |
| 9.232 | Sok Marketler Ticaret AS [^] | 12.202 | 0,01 | 3.691 | Costco Wholesale Corp | 1.867.572 | 1,33 |
| 103.681 | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS | 170.093 | 0,12 | 628 | Cummins Inc | 128.231 | 0,09 |
| 16.514 | Türkiye Is Bankasi AS 'C' ^{^^} | 9.094 | 0,01 | 8.000 | CVS Health Corp | 535.840 | 0,38 |
| 12.061 | Türkiye Petrol Rafinerileri AS [^] | 39.911 | 0,03 | 4.892 | Danaher Corp | 1.099.379 | 0,78 |
| | | 447.921 | 0,32 | 623 | Deere & Co | 217.041 | 0,15 |
| Großbritannien | | | | 76 | Domino's Pizza Inc | 22.187 | 0,02 |
| 395 | Anglo American Plc [^] | 11.003 | 0,01 | 2.963 | DTE Energy Co | 315.367 | 0,22 |
| 1.170 | AstraZeneca Plc | 169.109 | 0,12 | 9.502 | DuPont de Nemours Inc | 643.095 | 0,46 |
| 1.497 | Auto Trader Group Plc [^] | 11.734 | 0,01 | 5.870 | eBay Inc | 250.825 | 0,18 |
| 25.403 | Barclays Plc | 47.717 | 0,04 | 1.363 | Ecolab Inc | 223.968 | 0,16 |
| 1.655 | Bellway Plc | 46.301 | 0,03 | 321 | Electronic Arts Inc | 40.610 | 0,03 |
| 3.161 | BP Plc | 17.798 | 0,01 | 793 | Elevance Health Inc | 352.576 | 0,25 |
| 5.369 | British American Tobacco Plc [^] | 170.976 | 0,12 | 6.458 | EOG Resources Inc | 694.364 | 0,49 |
| 75.582 | Centrica Plc | 111.527 | 0,08 | 714 | Exelixis Inc | 13.637 | 0,01 |
| 7.420 | DS Smith Plc | 27.978 | 0,02 | 9.123 | Exxon Mobil Corp | 936.020 | 0,67 |
| 4.377 | easyJet Plc | 25.775 | 0,02 | 385 | Fidelity National Information Services Inc | 20.663 | 0,01 |
| 3.406 | Endeavour Mining Plc | 89.798 | 0,07 | 1.271 | Fortinet Inc | 87.254 | 0,06 |
| 4.693 | IG Group Holdings Plc [^] | 39.388 | 0,03 | 12.910 | Fox Corp 'A' | 404.858 | 0,29 |
| 1.388 | Johnson Matthey Plc | 29.631 | 0,02 | 988 | Fox Corp 'B' | 28.850 | 0,02 |
| 9.990 | Marks & Spencer Group Plc | 22.155 | 0,02 | 1.897 | Gartner Inc | 653.251 | 0,47 |
| 28.671 | Rightmove Plc | 186.403 | 0,13 | 3.754 | Gilead Sciences Inc | 287.406 | 0,20 |
| 6.760 | Shell Plc | 187.322 | 0,13 | 1.025 | Graco Inc [^] | 78.033 | 0,06 |
| 966 | Spectris Plc | 44.149 | 0,03 | 9.458 | Halliburton Co | 274.660 | 0,20 |
| 156.947 | Tesco Plc | 508.637 | 0,36 | 1.349 | HEICO Corp 'A' | 170.041 | 0,12 |
| | | 1.747.401 | 1,25 | 2.312 | Helmerich & Payne Inc | 74.007 | 0,05 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | 265 | Hershey Co | 68.232 | 0,05 |
| 7.158 | Abbott Laboratories | 722.815 | 0,52 | 2.360 | Hewlett Packard Enterprise Co | 34.208 | 0,02 |
| 3.668 | AbbVie Inc | 498.738 | 0,36 | 3.549 | Home Depot Inc | 1.013.665 | 0,72 |
| 4.375 | Adobe Inc | 1.816.938 | 1,30 | 6.603 | Honeywell International Inc | 1.265.795 | 0,90 |
| 3.321 | AECOM | 257.245 | 0,18 | 4.013 | HP Inc | 119.387 | 0,09 |
| 10.131 | Agilent Technologies Inc | 1.169.219 | 0,83 | 128 | IDEXX Laboratories Inc | 58.892 | 0,04 |
| 1.487 | Allstate Corp | 163.317 | 0,12 | 3.120 | Illinois Tool Works Inc [^] | 684.778 | 0,49 |
| 18.733 | Alphabet Inc 'A' | 2.306.594 | 1,64 | 1.333 | Incyte Corp | 82.553 | 0,06 |
| 11.776 | Alphabet Inc 'C' | 1.460.106 | 1,04 | 14.539 | Intel Corp | 440.968 | 0,31 |
| 14.623 | Altria Group Inc | 647.799 | 0,46 | 287 | ITT Inc | 22.065 | 0,02 |
| 29.169 | Amazon.com Inc | 3.552.201 | 2,53 | 9.862 | Johnson & Johnson | 1.519.340 | 1,08 |
| 6.973 | American Express Co | 1.104.872 | 0,79 | 209 | JPMorgan Chase & Co | 28.271 | 0,02 |
| 6.296 | AMETEK Inc | 919.027 | 0,66 | 1.270 | Keysight Technologies Inc | 206.769 | 0,15 |
| 1.504 | Amgen Inc | 328.669 | 0,23 | 23 | Lam Research Corp | 14.402 | 0,01 |
| 8.167 | Analog Devices Inc | 1.453.889 | 1,04 | 36 | Lennox International Inc | 10.023 | 0,01 |
| 38.301 | Apple Inc | 6.852.623 | 4,89 | 3.525 | Lowe's Cos Inc | 712.790 | 0,51 |
| 6.072 | Applied Materials Inc | 817.473 | 0,58 | 1.833 | Lululemon Athletica Inc | 607.493 | 0,43 |
| 632 | Archer-Daniels-Midland Co | 44.695 | 0,03 | 4.124 | Manhattan Associates Inc | 747.475 | 0,53 |
| 58 | AutoZone Inc | 135.605 | 0,10 | 741 | Marathon Oil Corp | 16.554 | 0,01 |
| 541 | Axon Enterprise Inc | 103.834 | 0,07 | 2.222 | Marathon Petroleum Corp | 233.999 | 0,17 |
| 32.287 | Bank of America Corp | 901.615 | 0,64 | 1.863 | Marsh & McLennan Cos Inc | 321.144 | 0,23 |
| 10.277 | Bank of New York Mellon Corp | 415.088 | 0,30 | 3.358 | Mastercard Inc 'A' | 1.208.779 | 0,86 |
| 1.646 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | 527.148 | 0,38 | 31 | MercadoLibre Inc | 38.466 | 0,03 |
| 105 | Biogen Inc | 31.164 | 0,02 | 6.288 | Meta Platforms Inc 'A' | 1.648.839 | 1,18 |
| 4.037 | Block Inc | 246.822 | 0,18 | 6.475 | MetLife Inc | 325.822 | 0,23 |
| | | | | 331 | Mettler-Toledo International Inc | 430.932 | 0,31 |
| | | | | 1.633 | MGM Resorts International | 63.981 | 0,05 |
| | | | | 20.568 | Microsoft Corp | 6.886.166 | 4,91 |
| | | | | 263 | Moderna Inc | 33.740 | 0,02 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) | USD |
|--|---------|---------|----------|-----------------------------------|------------|---|-----|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | |
| OFFENE DEWISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | | |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | | |
| EUR | 475.867 | USD | 525.572 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (17.082) | |
| USD | 32.745 | EUR | 30.295 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 373 | |
| | | | | | | (16.709) | |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 540.862) | | | | | | (16.709) | |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Nicht zyklische Konsumgüter | 20,45 |
| Technologie | 19,42 |
| Zyklische Konsumgüter | 12,29 |
| Finanzen | 11,89 |
| Industrie | 10,45 |
| Kommunikation | 9,88 |
| Grundstoffe | 6,37 |
| Energie | 6,25 |
| Versorger | 1,75 |
| Diversifiziert | 0,24 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 98,99 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 1,01 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in USD | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | |
| STAMMAKTIEN | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| 438 | ACELYRIN Inc | 7.884 | 0,02 |
| | | 7.884 | 0,02 |
| Gesamt Stammaktien | | 7.884 | 0,02 |
| ANLEIHEN | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| USD 5.750.000 | United States Treasury Bill 5/7/2023 (Zero Coupon) | 5.724.608 | 15,64 |
| USD 6.900.000 | United States Treasury Bill 6/7/2023 (Zero Coupon) | 6.868.245 | 18,77 |
| USD 9.000.000 | United States Treasury Bill 11/7/2023 (Zero Coupon) | 8.951.713 | 24,46 |
| USD 4.000.000 | United States Treasury Bill 13/7/2023 (Zero Coupon) | 3.977.227 | 10,87 |
| USD 6.300.000 | United States Treasury Bill 18/7/2023 (Zero Coupon) | 6.258.410 | 17,10 |
| USD 1.000.000 | United States Treasury Bill 24/8/2023 (Zero Coupon) | 988.328 | 2,70 |
| USD 2.000.000 | United States Treasury Bill 5/9/2023 (Zero Coupon) | 1.973.789 | 5,39 |
| USD 2.350.000 | United States Treasury Bill 7/9/2023 (Zero Coupon) | 2.318.999 | 6,34 |
| | | 37.061.319 | 101,27 |
| Gesamt Anleihen | | 37.061.319 | 101,27 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 37.069.203 | 101,29 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 37.069.203 | 101,29 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | | (470.940) | (1,29) |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (USD) | | 36.598.263 | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---|-------------------------------|---|----------------------------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | 579 | BHP Group Ltd | Morgan Stanley | (818) |
| Australien | | | | 59 | Blackmores Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3) |
| 2.886 | a2 Milk Co Ltd | Morgan Stanley | (168) | 38 | Blackmores Ltd | Goldman Sachs | (2) |
| 1.821 | Accent Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (867) | (7.867) | BlueScope Steel Ltd | Goldman Sachs | 4.893 |
| 1.733 | Accent Group Ltd | Goldman Sachs | (825) | (1.786) | Boral Ltd | Morgan Stanley | — |
| (13.219) | Adbri Ltd | Goldman Sachs | (4.625) | (1.786) | Boss Energy Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 5 |
| (5.991) | Adbri Ltd | Morgan Stanley | (2.193) | (6.248) | Boss Energy Ltd | Goldman Sachs | — |
| 8.050 | AGL Energy Ltd | Morgan Stanley | 2.660 | (899) | Brambles Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 396 |
| 1.051 | Allkem Ltd | Goldman Sachs | — | (1.761) | Breville Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.317 |
| 1.527 | Allkem Ltd | Morgan Stanley | (148) | (2.239) | Breville Group Ltd | Goldman Sachs | 1.751 |
| (3.964) | ALS Ltd | Goldman Sachs | 2.620 | (343) | Brickworks Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (138) |
| 32.552 | AMP Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 211 | (250) | Brickworks Ltd | Goldman Sachs | (100) |
| 31.439 | AMP Ltd | Goldman Sachs | 204 | (2.042) | BWP Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 159 |
| 22.932 | AMP Ltd | Morgan Stanley | 223 | (279) | BWP Trust (REIT) | Goldman Sachs | 22 |
| (1.181) | Ampol Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (773) | (3.181) | Capricorn Metals Ltd | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (1.041) | Ampol Ltd | Goldman Sachs | (681) | (10.160) | Capricorn Metals Ltd | Goldman Sachs | — |
| (747) | Ampol Ltd | Morgan Stanley | (160) | (370) | carsales.com Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 93 |
| (550) | ARB Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.226 | (1.212) | carsales.com Ltd | Goldman Sachs | 306 |
| (554) | ARB Corp Ltd | Goldman Sachs | 1.235 | (557) | carsales.com Ltd | Morgan Stanley | 159 |
| 1.667 | Arena (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (76) | (752) | Centuria Industrial (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 54 |
| 2.442 | Arena (REIT) | Goldman Sachs | (111) | (2.459) | Centuria Industrial (REIT) | Goldman Sachs | 175 |
| (1.956) | Argosy Minerals Ltd | Goldman Sachs | 32 | (2.611) | Chalice Mining Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 930 |
| 496 | Aristocrat Leisure Ltd | Morgan Stanley | (514) | 4.955 | Challenger Ltd | Goldman Sachs | 321 |
| (157) | ASX Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 134 | 6.270 | Challenger Ltd | Morgan Stanley | 853 |
| (132) | ASX Ltd | Goldman Sachs | 113 | (1.962) | Champion Iron Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 369 |
| (172) | ASX Ltd | Morgan Stanley | 97 | (2.943) | Champion Iron Ltd | Goldman Sachs | 553 |
| (26.067) | Atlas Arteria Ltd (Unit) | Goldman Sachs | 3.209 | 2.147 | Charter Hall Group (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (556) |
| (387) | AUB Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 349 | 1.694 | Charter Hall Group (REIT) | Goldman Sachs | (439) |
| (453) | AUB Group Ltd | Goldman Sachs | 401 | 2.768 | Charter Hall Group (REIT) | Morgan Stanley | (502) |
| 1.709 | Aurizon Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 55 | 3.765 | Charter Hall Long Wales (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (205) |
| 11.697 | Aurizon Holdings Ltd | Goldman Sachs | 379 | 6.056 | Charter Hall Long Wales (REIT) | Goldman Sachs | (409) |
| 1.434 | Aurizon Holdings Ltd | Morgan Stanley | 28 | 13.150 | Charter Hall Retail (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (984) |
| (4.030) | Australian Clinical Labs Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 914 | 23.832 | Charter Hall Retail (REIT) | Goldman Sachs | (1.946) |
| (720) | Australian Clinical Labs Ltd | Goldman Sachs | 163 | 4.400 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (228) |
| 3.323 | Australian Ethical Investment Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (667) | 6.555 | Charter Hall Social Infrastructure (REIT) | Goldman Sachs | (340) |
| 3.693 | Australian Ethical Investment Ltd | Goldman Sachs | (742) | (4.310) | Cleanaway Waste Management Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 140 |
| 9.489 | Bank of Queensland Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.230) | (55.504) | Cleanaway Waste Management Ltd | Goldman Sachs | 1.798 |
| 18.473 | Bank of Queensland Ltd | Goldman Sachs | (2.394) | (4.254) | Cleanaway Waste Management Ltd | Morgan Stanley | — |
| 5.054 | Bank of Queensland Ltd | Morgan Stanley | (426) | 304 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (205) |
| (1.572) | Bapcor Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 255 | 422 | Clinuvel Pharmaceuticals Ltd | Goldman Sachs | (284) |
| (2.126) | Bapcor Ltd | Goldman Sachs | 344 | (884) | Coles Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 200 |
| 4.611 | Beach Energy Ltd | Goldman Sachs | (15) | (721) | Coles Group Ltd | Goldman Sachs | 164 |
| 2.451 | Beach Energy Ltd | Morgan Stanley | (8) | (1.836) | Coles Group Ltd | Morgan Stanley | 190 |
| (8.084) | Bellevue Gold Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 288 | 265 | Collins Foods Ltd | Goldman Sachs | (37) |
| (13.769) | Bellevue Gold Ltd | Goldman Sachs | 491 | | | | |
| 771 | Bendigo & Adelaide Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (20) | | | | |
| 345 | Bendigo & Adelaide Bank Ltd | Morgan Stanley | (2) | | | | |
| 1.241 | BHP Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.566) | | | | |
| 314 | BHP Group Ltd | Goldman Sachs | (372) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|---|-----------------|---|-------------------------------|----------------------------------|-----------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| (15.838) | Coronado Global | | | (829) | GUD Holdings Ltd | Bank of America | |
| | Resources Inc - CDI | Goldman Sachs | 1.847 | | | Merrill Lynch | 231 |
| (2.103) | Corporate Travel Management Ltd | Bank of America | | (2.634) | GUD Holdings Ltd | Goldman Sachs | 734 |
| | | Merrill Lynch | 341 | 740 | Harvey Norman Holdings Ltd | Bank of America | |
| (1.609) | Corporate Travel Management Ltd | | | | | Merrill Lynch | (139) |
| | | Goldman Sachs | 261 | (1.580) | Healius Ltd | Bank of America | |
| (2.598) | Costa Group Holdings Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (41) |
| | | Merrill Lynch | (252) | (3.289) | Healius Ltd | Goldman Sachs | (85) |
| (1.440) | Costa Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | (140) | (963) | HomeCo Daily Needs (REIT) | Bank of America | |
| | 915 Credit Corp Group Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 19 |
| | | Merrill Lynch | 83 | (15.134) | HomeCo Daily Needs (REIT) | Goldman Sachs | 294 |
| 1.268 | Credit Corp Group Ltd | Goldman Sachs | 115 | (104) | HUB24 Ltd | Bank of America | |
| (52) | CSL Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 198 |
| | | Merrill Lynch | 48 | (104) | HUB24 Ltd | Goldman Sachs | 198 |
| (182) | CSL Ltd | Goldman Sachs | 167 | 134 | IDP Education Ltd | Bank of America | |
| (58) | CSL Ltd | Morgan Stanley | 12 | | | Merrill Lynch | (504) |
| 1.240 | CSR Ltd | Bank of America | | 429 | IDP Education Ltd | Goldman Sachs | (1.615) |
| | | Merrill Lynch | (345) | 831 | IDP Education Ltd | Morgan Stanley | (2.773) |
| 3.425 | CSR Ltd | Goldman Sachs | (954) | (1.079) | IGO Ltd | Goldman Sachs | 287 |
| 3.017 | CSR Ltd | Morgan Stanley | (938) | (644) | IGO Ltd | Morgan Stanley | 259 |
| (6.130) | De Grey Mining Ltd | Bank of America | | 2.246 | Iluka Resources Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 596 | | | Merrill Lynch | 116 |
| (8.697) | De Grey Mining Ltd | Goldman Sachs | 845 | 269 | Iluka Resources Ltd | Goldman Sachs | 14 |
| 2.943 | Dexus Industria (REIT) | Goldman Sachs | (210) | 1.661 | Iluka Resources Ltd | Morgan Stanley | (54) |
| (943) | Dicker Data Ltd | Bank of America | | 3.884 | Imdex Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 293 | | | Merrill Lynch | (642) |
| (1.647) | Dicker Data Ltd | Goldman Sachs | 512 | 10.773 | Imdex Ltd | Goldman Sachs | (1.780) |
| 6.101 | Domain Holdings Australia Ltd | Bank of America | | (81.116) | Imugene Ltd | Goldman Sachs | 526 |
| | | Merrill Lynch | 712 | (8.684) | Ingenia Communities Group (REIT) | Bank of America | |
| 3.703 | Domain Holdings Australia Ltd | Goldman Sachs | 432 | (11.027) | Ingenia Communities Group (REIT) | Goldman Sachs | 1.357 |
| 4.152 | Domain Holdings Australia Ltd | Morgan Stanley | 27 | (19.641) | Inghams Group Ltd | Goldman Sachs | 2.672 |
| 23.179 | Downer EDI Ltd | Bank of America | | 4.753 | Insignia Financial Ltd | Morgan Stanley | (462) |
| | | Merrill Lynch | (1.502) | (945) | Integral Diagnostics Ltd | Bank of America | |
| 12.824 | Downer EDI Ltd | Goldman Sachs | (831) | | | Merrill Lynch | 61 |
| 16.546 | Downer EDI Ltd | Morgan Stanley | (536) | (1.376) | Integral Diagnostics Ltd | Goldman Sachs | 89 |
| 294 | Eagers Automotive Ltd | Bank of America | | (807) | IPH Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (349) | | | Merrill Lynch | 76 |
| 1.474 | Eagers Automotive Ltd | Goldman Sachs | (1.748) | (1.306) | IPH Ltd | Goldman Sachs | 136 |
| 871 | Elders Ltd | Bank of America | | (3.219) | IRESS Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (451) | | | Merrill Lynch | 456 |
| 1.184 | Elders Ltd | Goldman Sachs | (614) | (3.703) | IRESS Ltd | Goldman Sachs | 569 |
| 7.654 | Flight Centre Travel Group Ltd | | | (14.560) | Jervois Global Ltd | Bank of America | |
| | | Morgan Stanley | (744) | | | Merrill Lynch | 113 |
| 408 | Fortescue Metals Group Ltd | Bank of America | | (20.314) | Jervois Global Ltd | Goldman Sachs | 158 |
| | | Merrill Lynch | (307) | 841 | Johns Lyng Group Ltd | Bank of America | |
| 463 | Fortescue Metals Group Ltd | | | | | Merrill Lynch | (262) |
| (411) | G8 Education Ltd | Morgan Stanley | (402) | 1.873 | Johns Lyng Group Ltd | Goldman Sachs | (582) |
| | | Bank of America | | 811 | Jumbo Interactive Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 27 | | | Merrill Lynch | 247 |
| (9.098) | G8 Education Ltd | Goldman Sachs | 589 | 2.040 | Jumbo Interactive Ltd | Goldman Sachs | 621 |
| (4.300) | Gold Road Resources Ltd | Bank of America | | (5.086) | Kelsian Group Ltd | Goldman Sachs | (2.283) |
| | | Merrill Lynch | 488 | (798) | Lendlease Corp Ltd (Unit) | Bank of America | |
| (4.195) | Gold Road Resources Ltd | Goldman Sachs | 476 | | | Merrill Lynch | 150 |
| (1.286) | Goodman Group (REIT) | Bank of America | | (2.195) | Leo Lithium Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 633 | | | Merrill Lynch | (327) |
| (4.458) | Goodman Group (REIT) | Goldman Sachs | 2.195 | (13.728) | Leo Lithium Ltd | Goldman Sachs | (2.046) |
| (662) | Goodman Group (REIT) | Morgan Stanley | 210 | 219 | Lifestyle Communities Ltd | Bank of America | |
| 6.795 | GPT Group (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (257) |
| | | Merrill Lynch | (1.145) | 117 | Lifestyle Communities Ltd | Goldman Sachs | (137) |
| 865 | GPT Group (REIT) | Goldman Sachs | (146) | (4.299) | Link Administration Holdings Ltd | Bank of America | |
| 2.528 | GPT Group (REIT) | Morgan Stanley | (229) | | | Merrill Lynch | 447 |
| 2.279 | GrainCorp Ltd 'A' | Bank of America | | (8.372) | Link Administration Holdings Ltd | Goldman Sachs | 921 |
| | | Merrill Lynch | (596) | (17.615) | Lottery Corp Ltd | Goldman Sachs | (342) |
| 4.977 | GrainCorp Ltd 'A' | Goldman Sachs | (1.135) | 159 | Lovisa Holdings Ltd | Bank of America | |
| 6.526 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (535) |
| | | Merrill Lynch | (1.184) | 1.012 | Lovisa Holdings Ltd | Goldman Sachs | (3.403) |
| 5.258 | Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT) | Goldman Sachs | (866) | 1.550 | Lynas Rare Earths Ltd | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 201 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|------------------------------------|-----------------|---|-------------------------------|--------------------------------------|-----------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Australien Fortsetzung | | | |
| 474 | Lynas Rare Earths Ltd | Goldman Sachs | 61 | (16.624) | Paladin Energy Ltd | Bank of America | |
| 981 | Lynas Rare Earths Ltd | Morgan Stanley | 127 | | | Merrill Lynch | 1.185 |
| 216 | Macquarie Group Ltd | Bank of America | | (19.131) | Paladin Energy Ltd | Goldman Sachs | 1.363 |
| | | Merrill Lynch | (574) | 9.365 | Perenti Ltd | Bank of America | |
| 353 | Macquarie Group Ltd | Goldman Sachs | (938) | | | Merrill Lynch | (243) |
| 382 | Macquarie Group Ltd | Morgan Stanley | (1.443) | 23.891 | Perenti Ltd | Goldman Sachs | (619) |
| 814 | Magellan Financial Group Ltd | Goldman Sachs | (295) | 22.607 | Perseus Mining Ltd | Bank of America | |
| 938 | Magellan Financial Group Ltd | Morgan Stanley | (219) | | | Merrill Lynch | (3.985) |
| (81) | McMillan Shakespeare Ltd | Bank of America | | 17.462 | Perseus Mining Ltd | Goldman Sachs | (3.338) |
| | | Merrill Lynch | 1 | (1.833) | PEXA Group Ltd | Bank of America | |
| (1.239) | Megaport Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 392 |
| | | Merrill Lynch | (1.004) | (3.494) | PEXA Group Ltd | Goldman Sachs | 747 |
| (1.421) | Megaport Ltd | Goldman Sachs | (1.289) | 1.735 | Pinnacle Investment | | |
| 1.861 | Mineral Resources Ltd | Goldman Sachs | (3.569) | | Management Group Ltd | Goldman Sachs | (101) |
| 202 | Mineral Resources Ltd | Morgan Stanley | (517) | (662) | Pointsbet Holdings Ltd ^{II} | Goldman Sachs | — |
| 2.645 | Mirvac Group (REIT) | Bank of America | | (15.221) | PointsBet Holdings Ltd | Goldman Sachs | 1.430 |
| | | Merrill Lynch | (86) | 1.668 | Premier Investments Ltd | Bank of America | |
| 2.792 | Mirvac Group (REIT) | Goldman Sachs | (90) | | | Merrill Lynch | (3.015) |
| 3.177 | Mirvac Group (REIT) | Morgan Stanley | (21) | 1.424 | Premier Investments Ltd | Goldman Sachs | (2.386) |
| 977 | Monadelphous Group Ltd | Goldman Sachs | (671) | 1.035 | Pro Medicus Ltd | Bank of America | |
| 5.079 | Nanosonics Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (570) |
| | | Merrill Lynch | (263) | 379 | Pro Medicus Ltd | Goldman Sachs | (209) |
| 5.979 | Nanosonics Ltd | Goldman Sachs | (310) | 518 | Pro Medicus Ltd | Morgan Stanley | (336) |
| 1.178 | National Australia Bank Ltd | Morgan Stanley | (458) | 1.126 | PWR Holdings Ltd | Bank of America | |
| 13.602 | National Storage (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (292) |
| | | Merrill Lynch | (264) | 465 | PWR Holdings Ltd | Goldman Sachs | (121) |
| 15.650 | National Storage (REIT) | Goldman Sachs | (309) | 11.036 | Ramelius Resources Ltd | Bank of America | |
| 1.155 | Netwealth Group Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (179) |
| | | Merrill Lynch | (636) | 10.870 | Ramelius Resources Ltd | Goldman Sachs | (176) |
| 1.167 | Netwealth Group Ltd | Goldman Sachs | (643) | (522) | Ramsay Health Care Ltd | Goldman Sachs | 1.363 |
| (82) | Neuren Pharmaceuticals Ltd | Goldman Sachs | 19 | (253) | Ramsay Health Care Ltd | Morgan Stanley | 402 |
| 200 | Newcrest Mining Ltd | Goldman Sachs | (246) | (106) | REA Group Ltd | Bank of America | |
| 453 | Newcrest Mining Ltd | Morgan Stanley | (370) | | | Merrill Lynch | (57) |
| (1.678) | NEXTDC Ltd | Bank of America | | (26) | REA Group Ltd | Morgan Stanley | 17 |
| | | Merrill Lynch | (1.062) | (5.926) | Reece Ltd | Goldman Sachs | (115) |
| (5.264) | NEXTDC Ltd | Goldman Sachs | (2.933) | (505) | Reece Ltd | Morgan Stanley | 33 |
| (1.197) | NEXTDC Ltd | Morgan Stanley | (589) | 3.026 | Region RE Ltd (REIT) | Bank of America | |
| (261) | nib holdings Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (59) |
| | | Merrill Lynch | (47) | 5.451 | Region RE Ltd (REIT) | Goldman Sachs | (106) |
| (1.460) | nib holdings Ltd | Goldman Sachs | (303) | 9.081 | Region RE Ltd (REIT) | Morgan Stanley | 235 |
| 1.113 | Nick Scali Ltd | Bank of America | | 8.695 | Regis Resources Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (901) | | | Merrill Lynch | (732) |
| 1.010 | Nick Scali Ltd | Goldman Sachs | (818) | 17.073 | Regis Resources Ltd | Goldman Sachs | (1.438) |
| (2.903) | Nickel Industries Ltd | Bank of America | | (10.130) | Reliance Worldwide Corp Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 47 | | | Merrill Lynch | (394) |
| (7.433) | Nickel Industries Ltd | Goldman Sachs | 120 | (7.811) | Reliance Worldwide Corp Ltd | Goldman Sachs | (304) |
| (14.802) | Nine Entertainment Co Holdings Ltd | Bank of America | | 598 | Rio Tinto Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 863 | | | Merrill Lynch | (859) |
| (14.130) | Nine Entertainment Co Holdings Ltd | Goldman Sachs | 824 | 254 | Rio Tinto Ltd | Goldman Sachs | (323) |
| (3.169) | Northern Star Resources Ltd | Goldman Sachs | 2.176 | 872 | Rio Tinto Ltd | Morgan Stanley | (1.266) |
| (1.245) | NRW Holdings Ltd | Bank of America | | 1.562 | Rural Funds Group (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 137 | | | Merrill Lynch | (162) |
| (2.699) | NRW Holdings Ltd | Goldman Sachs | 297 | 3.268 | Rural Funds Group (REIT) | Goldman Sachs | (339) |
| (5.198) | Nufarm Ltd | Goldman Sachs | (202) | (27.905) | Santos Ltd | Goldman Sachs | (2.170) |
| 615 | Objective Corp Ltd | Bank of America | | (2.967) | Santos Ltd | Morgan Stanley | 173 |
| | | Merrill Lynch | 343 | (113.206) | Sayona Mining Ltd | Goldman Sachs | 3.301 |
| 849 | Objective Corp Ltd | Goldman Sachs | 473 | 1.740 | Scentre Group (REIT) | Goldman Sachs | (147) |
| (475) | Omni Bridgeway Ltd | Bank of America | | 5.107 | Scentre Group (REIT) | Morgan Stanley | (265) |
| | | Merrill Lynch | 40 | 2.375 | SEEK Ltd | Bank of America | |
| (7.054) | Omni Bridgeway Ltd | Goldman Sachs | 594 | | | Merrill Lynch | (769) |
| 10.137 | oOh!media Ltd | Bank of America | | 572 | SEEK Ltd | Goldman Sachs | (185) |
| | | Merrill Lynch | (361) | 1.209 | SEEK Ltd | Morgan Stanley | (595) |
| 20.741 | oOh!media Ltd | Goldman Sachs | (739) | (1.381) | Select Harvests Ltd | Bank of America | |
| 5.593 | Orora Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (45) |
| | | Merrill Lynch | (290) | (949) | Select Harvests Ltd | Goldman Sachs | (31) |
| 5.151 | Orora Ltd | Goldman Sachs | (267) | (1.747) | Seven Group Holdings Ltd | Bank of America | |
| 1.187 | Orora Ltd | Morgan Stanley | (15) | | | Merrill Lynch | 543 |
| | | | | (6.681) | Seven Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | 2.078 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---|-------------------------------|--|----------------------------------|---|
| Australien Fortsetzung | | | | Österreich Fortsetzung | | | |
| (1.308) | Seven Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | 712 | (291) | CA Immobilien Anlagen AG | Goldman Sachs | (140) |
| (381) | Sigma Healthcare Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 12 | (762) | Erste Group Bank AG | Bank of America Merrill Lynch | 480 |
| (29.251) | Sigma Healthcare Ltd | Goldman Sachs | 948 | (86) | Erste Group Bank AG | Goldman Sachs | 54 |
| 15.808 | Silver Lake Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (512) | (263) | Erste Group Bank AG | Morgan Stanley | 357 |
| 3.351 | Silver Lake Resources Ltd | Goldman Sachs | (109) | (21) | EVN AG | Bank of America Merrill Lynch | 45 |
| (220) | SmartGroup Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 10 | (142) | EVN AG | Goldman Sachs | 303 |
| (434) | SmartGroup Corp Ltd | Goldman Sachs | 20 | 396 | IMMOFINANZ AG | Bank of America Merrill Lynch | 51 |
| (10.523) | South32 Ltd | Goldman Sachs | 1.091 | 365 | IMMOFINANZ AG | Goldman Sachs | 43 |
| 2.031 | Steadfast Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (53) | (107) | OMV AG | Goldman Sachs | 95 |
| 2.291 | Steadfast Group Ltd | Goldman Sachs | (59) | (1.888) | OMV AG | Morgan Stanley | 2.298 |
| 2.891 | Steadfast Group Ltd | Morgan Stanley | (75) | 139 | Palfinger AG | Bank of America Merrill Lynch | (215) |
| (140) | Super Retail Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 128 | 212 | Palfinger AG | Goldman Sachs | (328) |
| (1.918) | Super Retail Group Ltd | Goldman Sachs | 1.752 | 412 | Porr AG | Goldman Sachs | (79) |
| (2.580) | Syrah Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 114 | 1.751 | Raiffeisen Bank International AG | Bank of America Merrill Lynch | (411) |
| (25.967) | Tabcorp Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (589) | 2.404 | Raiffeisen Bank International AG | Goldman Sachs | (565) |
| (101.319) | Tabcorp Holdings Ltd | Goldman Sachs | (2.298) | 5.031 | Raiffeisen Bank International AG | Morgan Stanley | (4.351) |
| 5.905 | Technology One Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 5.739 | 8 | Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG | Bank of America Merrill Lynch | (11) |
| 3.527 | Technology One Ltd | Goldman Sachs | 3.222 | 76 | Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG | Goldman Sachs | (106) |
| (1.456) | Telix Pharmaceuticals Ltd | Goldman Sachs | (594) | (280) | Semperit AG Holding | Bank of America Merrill Lynch | 179 |
| (43.238) | Tietto Minerals Ltd | Goldman Sachs | 1.261 | (811) | Semperit AG Holding | Goldman Sachs | 519 |
| 3.002 | Treasury Wine Estates Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.248) | 1.644 | UNIQA Insurance Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (201) |
| 12.799 | Treasury Wine Estates Ltd | Goldman Sachs | (13.848) | 582 | Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe | Bank of America Merrill Lynch | (1.181) |
| 2.591 | Treasury Wine Estates Ltd | Morgan Stanley | (2.736) | 394 | Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe | Goldman Sachs | (799) |
| (989) | Tyro Payments Ltd | Goldman Sachs | 211 | | | | (5.721) |
| (9.336) | United Malt Grp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.389 | Belgien | | | |
| (10.726) | United Malt Grp Ltd | Goldman Sachs | 1.642 | (32) | Ackermans & van Haaren NV | Bank of America Merrill Lynch | 185 |
| 5.708 | Ventia Services Group Pty Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (111) | (12) | Ackermans & van Haaren NV | Goldman Sachs | 69 |
| 7.003 | Ventia Services Group Pty Ltd | Goldman Sachs | (136) | (17) | Ackermans & van Haaren NV | Morgan Stanley | 140 |
| 3.803 | Viva Energy Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (44) | (187) | Aedifica SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.557 |
| 13.384 | Viva Energy Group Ltd | Goldman Sachs | (64) | (810) | Aedifica SA (REIT) | Goldman Sachs | 6.746 |
| 16.221 | Waypoint Ltd (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 107 | (675) | Anheuser-Busch InBev SA | Bank of America Merrill Lynch | 4.332 |
| 11.687 | Waypoint Ltd (REIT) | Goldman Sachs | 83 | (57) | Argenx SE | Bank of America Merrill Lynch | 450 |
| (9.451) | Webjet Ltd | Goldman Sachs | (1.286) | (12) | Argenx SE | Goldman Sachs | 95 |
| 106 | Wesfarmers Ltd | Goldman Sachs | (264) | (71) | Argenx SE | Morgan Stanley | 1.698 |
| 3.347 | West African Resources Ltd | Goldman Sachs | (254) | 1.814 | Barco NV | Bank of America Merrill Lynch | (1.761) |
| 136 | Westpac Banking Corp | Bank of America Merrill Lynch | (40) | 1.115 | Barco NV | Goldman Sachs | (1.068) |
| 6.891 | Westpac Banking Corp | Morgan Stanley | (1.697) | (488) | Bekaert SA | Bank of America Merrill Lynch | 542 |
| 145 | WiseTech Global Ltd | Goldman Sachs | 341 | (901) | Bekaert SA | Goldman Sachs | 1.001 |
| 880 | WiseTech Global Ltd | Morgan Stanley | 1.038 | (3) | Biocartis Group NV ^{††} | Goldman Sachs | — |
| (500) | Woodside Energy Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 173 | (1.178) | bpost SA | Bank of America Merrill Lynch | 712 |
| (5.309) | Woodside Energy Group Ltd | Morgan Stanley | 1.296 | (3.752) | bpost SA | Goldman Sachs | 2.267 |
| 1.898 | Worley Ltd | Morgan Stanley | (209) | (190) | Cofinimmo SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.177 |
| 65 | Xero Ltd | Goldman Sachs | 3 | | | | |
| 90 | Xero Ltd | Morgan Stanley | 7 | | | | |
| | | | (42.281) | | | | |
| Österreich | | | | | | | |
| 201 | ANDRITZ AG | Morgan Stanley | (987) | | | | |
| 241 | BAWAG Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (304) | | | | |
| 157 | BAWAG Group AG | Goldman Sachs | (198) | | | | |
| (120) | CA Immobilien Anlagen AG | Bank of America Merrill Lynch | (58) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|--|-----------------|---|----------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|
| Belgien Fortsetzung | | | | Belgien Fortsetzung | | | |
| (733) | Cofinimmo SA (REIT) | Goldman Sachs | 4.539 | (888) | UCB SA | Morgan Stanley | 5.765 |
| (62) | Deme Group NV | Bank of America | | (270) | Umicore SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 220 | | | Merrill Lynch | 908 |
| (127) | Deme Group NV | Goldman Sachs | 428 | (82) | Umicore SA | Goldman Sachs | 276 |
| (101) | D'ieteren Group | Goldman Sachs | 539 | (245) | Umicore SA | Morgan Stanley | 683 |
| (430) | D'ieteren Group | Morgan Stanley | 2.755 | (159) | VGP NV | Bank of America | |
| 118 | Elia Group SA | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 569 |
| | | Merrill Lynch | (1.525) | (141) | VGP NV | Goldman Sachs | 504 |
| 120 | Elia Group SA | Goldman Sachs | (1.550) | (192) | Xior Student Housing NV (REIT) | Bank of America | |
| 111 | Elia Group SA | Morgan Stanley | (604) | | | Merrill Lynch | 154 |
| (148) | Etablissements Franz Colruyt NV | Bank of America | | (275) | Xior Student Housing NV (REIT) | Goldman Sachs | 185 |
| (672) | Etablissements Franz Colruyt NV | Merrill Lynch | (43) | | | | |
| | | | | | | | 24.426 |
| 744 | Euronav NV | Goldman Sachs | (194) | Kanada | | | |
| | | Bank of America | | (2.033) | Absolute Software Corp | Goldman Sachs | (119) |
| | | Merrill Lynch | (445) | (360) | ADENTRA Inc | Bank of America | |
| 919 | Euronav NV | Goldman Sachs | (550) | | | Merrill Lynch | 4 |
| 810 | Exmar NV | Bank of America | | (459) | ADENTRA Inc | Goldman Sachs | 5 |
| | | Merrill Lynch | (1.072) | 513 | Advantage Energy Ltd | Bank of America | |
| 1.427 | Exmar NV | Goldman Sachs | (1.889) | | | Merrill Lynch | (60) |
| 938 | Fagron | Bank of America | | 610 | Advantage Energy Ltd | Goldman Sachs | (72) |
| | | Merrill Lynch | 74 | 1.409 | Aecon Group Inc | Bank of America | |
| 1.292 | Fagron | Goldman Sachs | 110 | | | Merrill Lynch | 176 |
| (506) | Intervest Offices & Warehouses NV (REIT) | Bank of America | | 1.288 | Aecon Group Inc | Goldman Sachs | 161 |
| (665) | Intervest Offices & Warehouses NV (REIT) | Merrill Lynch | 256 | (176) | Ag Growth International Inc | Bank of America | |
| 83 | Ion Beam Applications | Goldman Sachs | 326 | | | Merrill Lynch | 297 |
| | | Bank of America | | (33) | Ag Growth International Inc | Goldman Sachs | 56 |
| | | Merrill Lynch | (115) | (5.125) | Air Canada | Morgan Stanley | (903) |
| 34 | Ion Beam Applications | Goldman Sachs | (47) | 1.053 | Alamos Gold Inc 'A' | Bank of America | |
| (79) | KBC Ancora | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.361) |
| | | Merrill Lynch | (86) | 767 | Alamos Gold Inc 'A' | Goldman Sachs | (991) |
| (208) | KBC Ancora | Goldman Sachs | (227) | 974 | Alamos Gold Inc 'A' | Morgan Stanley | (586) |
| (495) | KBC Group NV | Bank of America | | (592) | Algoma Steel Group Inc | Goldman Sachs | 283 |
| | | Merrill Lynch | 317 | (2.374) | Algonquin Power & Utilities Corp | | |
| (148) | KBC Group NV | Goldman Sachs | 95 | | | Goldman Sachs | 715 |
| (179) | KBC Group NV | Morgan Stanley | (122) | (1.073) | Allied Properties (REIT) | Bank of America | |
| (422) | Kinepolis Group NV | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 433 |
| | | Merrill Lynch | 1.712 | (1.272) | Allied Properties (REIT) | Goldman Sachs | 506 |
| (453) | Kinepolis Group NV | Goldman Sachs | 1.838 | 295 | Altius Minerals Corp | Bank of America | |
| 369 | Melexis NV | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (130) |
| | | Merrill Lynch | 857 | 1.770 | Altius Minerals Corp | Goldman Sachs | (780) |
| 792 | Melexis NV | Goldman Sachs | 1.903 | (359) | Altus Group Ltd | Bank of America | |
| 114 | Montea NV (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (824) |
| | | Merrill Lynch | (402) | (256) | Altus Group Ltd | Goldman Sachs | (594) |
| 94 | Montea NV (REIT) | Goldman Sachs | (331) | (227) | Andlauer Healthcare Group Inc | Bank of America | |
| 319 | Ontex Group NV | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 210 |
| | | Merrill Lynch | (225) | (224) | Andlauer Healthcare Group Inc | Goldman Sachs | 251 |
| 617 | Ontex Group NV | Goldman Sachs | (435) | (69) | Aritzia Inc | Morgan Stanley | 73 |
| (240) | Recticel SA | Bank of America | | 2.797 | Artis (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (103) | | | Merrill Lynch | (144) |
| (645) | Recticel SA | Goldman Sachs | (275) | 4.238 | Artis (REIT) | Goldman Sachs | (218) |
| 87 | Shurgard Self Storage Ltd (REIT) | Bank of America | | (1.392) | Atco Ltd 'I' | Morgan Stanley | 1.502 |
| 137 | Shurgard Self Storage Ltd (REIT) | Merrill Lynch | (299) | (221) | ATS Corp | Bank of America | |
| 402 | Sofina SA | Goldman Sachs | (470) | | | Merrill Lynch | (419) |
| | | Bank of America | | (736) | ATS Corp | Goldman Sachs | (1.394) |
| | | Merrill Lynch | (1.873) | (147) | Badger Infrastructure Solutions Ltd | Bank of America | |
| 228 | Sofina SA | Goldman Sachs | (1.086) | | | Merrill Lynch | 121 |
| 210 | Sofina SA | Morgan Stanley | (1.816) | (96) | Badger Infrastructure Solutions Ltd | Goldman Sachs | 79 |
| 360 | Solvay SA | Bank of America | | 1.475 | Ballard Power Systems Inc | Goldman Sachs | (487) |
| | | Merrill Lynch | (2.748) | (139) | Bank of Nova Scotia | Goldman Sachs | 57 |
| 437 | Solvay SA | Goldman Sachs | (3.521) | 794 | Baytex Energy Corp | Bank of America | |
| 406 | Solvay SA | Morgan Stanley | (3.208) | | | Merrill Lynch | (105) |
| (1.784) | Telenet Group Holding NV | Bank of America | | 2.216 | Baytex Energy Corp | Morgan Stanley | (602) |
| | | Merrill Lynch | 93 | (2.222) | BELLUS Health Inc | Goldman Sachs | (452) |
| (1.153) | Tessengerlo Group SA | Bank of America | | 5.403 | Birchcliff Energy Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.123 | | | Merrill Lynch | (79) |
| (1.497) | Tessengerlo Group SA | Goldman Sachs | 2.845 | 438 | Birchcliff Energy Ltd | Morgan Stanley | (154) |
| (267) | UCB SA | Bank of America | | (453) | BlackBerry Ltd | Morgan Stanley | 23 |
| | | Merrill Lynch | 1.471 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|---|----------------------------------|---|---------------------------|---------------------------------------|----------------------------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| 184 | Boardwalk (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (526) | (381) | Cogeco Communications Inc | Goldman Sachs | (61) |
| 536 | Boardwalk (REIT) | Goldman Sachs | (1.531) | (503) | Cogeco Inc | Bank of America Merrill Lynch | (111) |
| 852 | Bombardier Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (1.357) | (323) | Cogeco Inc | Goldman Sachs | (71) |
| 589 | Bombardier Inc 'B' | Goldman Sachs | (938) | (4.745) | Converge Technology Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.568) |
| 294 | Bombardier Inc 'B' | Morgan Stanley | (872) | (4.403) | Converge Technology Solutions Corp | Goldman Sachs | (1.455) |
| 45 | Boyd Group Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 314 | (1) | Corby Spirit and Wine Ltd" | Goldman Sachs | — |
| 89 | Boyd Group Services Inc | Goldman Sachs | 648 | 133 | Crew Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 15 |
| (540) | Brookfield Asset Management Ltd 'A' | Goldman Sachs | 567 | 506 | Crew Energy Inc | Goldman Sachs | 56 |
| (1.326) | Brookfield Asset Management Ltd 'A' | Morgan Stanley | 1.382 | 547 | Crombie (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (470) |
| (1.190) | Brookfield Corp | Bank of America Merrill Lynch | 9 | 541 | Crombie (REIT) | Goldman Sachs | (465) |
| (169) | Brookfield Reinsurance Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 211 | 99 | CT (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (49) |
| (471) | Brookfield Reinsurance Ltd | Goldman Sachs | 577 | 752 | CT (REIT) | Goldman Sachs | (375) |
| (350) | CAE Inc | Morgan Stanley | 185 | (594) | Definity Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 122 |
| (1.051) | Cameco Corp | Goldman Sachs | 1.011 | (862) | Definity Financial Corp | Goldman Sachs | 177 |
| (1.154) | Cameco Corp | Morgan Stanley | 2.033 | (225) | Dream Industrial (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 76 |
| 1.035 | Canaccord Genuity Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 30 | (1.348) | Dream Industrial (REIT) | Goldman Sachs | 455 |
| 1.211 | Canaccord Genuity Group Inc | Goldman Sachs | 36 | (2.597) | Dream Industrial (REIT) | Morgan Stanley | 591 |
| 2.339 | Canada Goose Holdings Inc | Goldman Sachs | (9.930) | (137) | Dream Office (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (8) |
| (1.382) | Canadian Apartment Properties (REIT) | Goldman Sachs | 1.613 | 496 | DREAM Unlimited Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (280) |
| (2.787) | Canadian Apartment Properties (REIT) | Morgan Stanley | (430) | 330 | DREAM Unlimited Corp 'A' | Goldman Sachs | (187) |
| 58 | Canadian Natural Resources Ltd | Morgan Stanley | (221) | 2.862 | Dundee Precious Metals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.933) |
| (27) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Goldman Sachs | 137 | 2.725 | Dundee Precious Metals Inc | Goldman Sachs | (1.776) |
| (222) | Canadian Pacific Kansas City Ltd | Morgan Stanley | 468 | (121) | Dye & Durham Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 28 |
| 29 | Canadian Tire Corp Ltd 'A' | Goldman Sachs | (48) | (1.172) | Dye & Durham Ltd Management Corp | Goldman Sachs | 268 |
| (951) | Canadian Utilities Ltd 'A' | Morgan Stanley | 314 | 887 | Element Fleet Management Corp | Bank of America Merrill Lynch | (316) |
| (2.469) | Canadian Western Bank | Bank of America Merrill Lynch | (653) | 3.385 | Element Fleet Management Corp | Goldman Sachs | (1.205) |
| (961) | Canadian Western Bank | Goldman Sachs | (254) | 2.977 | Element Fleet Management Corp | Morgan Stanley | (98) |
| (162) | Canfor Corp | Bank of America Merrill Lynch | 221 | 1.857 | Emera Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.518) |
| (251) | Canfor Corp | Goldman Sachs | 343 | 1.269 | Emera Inc | Goldman Sachs | (2.151) |
| 1.978 | Cardinal Energy Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 392 | 914 | Emera Inc | Morgan Stanley | (383) |
| 525 | Cardinal Energy Ltd | Goldman Sachs | 104 | 359 | Endeavour Silver Corp | Bank of America Merrill Lynch | (95) |
| (36) | Cargojet Inc | Bank of America Merrill Lynch | 28 | (1.306) | Enerflex Ltd | Goldman Sachs | 748 |
| (49) | Cargojet Inc | Goldman Sachs | 121 | (404) | Energy Fuels Inc | Bank of America Merrill Lynch | 172 |
| (1.572) | Cascades Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.547 | (1.667) | Energy Fuels Inc | Goldman Sachs | 710 |
| (469) | Cascades Inc | Goldman Sachs | 461 | 3.178 | Enerplus Corp | Bank of America Merrill Lynch | (770) |
| (1.049) | CCL Industries Inc 'B' | Morgan Stanley | 3.419 | 2.080 | Enerplus Corp | Goldman Sachs | (504) |
| 1 | Celestica Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2 | 5.125 | Enerplus Corp | Morgan Stanley | (4.327) |
| 153 | Celestica Inc | Goldman Sachs | 279 | 54 | Enghouse Systems Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (23) |
| (863) | Cenovus Energy Inc | Morgan Stanley | 444 | 31 | Enghouse Systems Ltd | Goldman Sachs | (5) |
| 1.655 | Centerra Gold Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.319 | 78 | EQB Inc | Bank of America Merrill Lynch | 35 |
| 566 | Centerra Gold Inc | Goldman Sachs | 407 | 144 | EQB Inc | Goldman Sachs | 66 |
| 219 | CGI Inc | Goldman Sachs | 35 | 375 | ERO Copper Corp | Bank of America Merrill Lynch | (424) |
| 33 | CGI Inc | Morgan Stanley | 45 | 198 | ERO Copper Corp | Goldman Sachs | (224) |
| (3.758) | Choice Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.987 | 305 | Evertz Technologies Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (11) |
| (2.188) | Choice Properties (REIT) | Goldman Sachs | 1.157 | 659 | Evertz Technologies Ltd | Goldman Sachs | (24) |
| (485) | CI Financial Corp | Goldman Sachs | (228) | | | | |
| (345) | CI Financial Corp | Morgan Stanley | (96) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|---|---------------------------|--|-------------------------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| (698) | Exchange Income Corp | Bank of America Merrill Lynch | 126 | (3.641) | InterRent (REIT) | Goldman Sachs | 1.898 |
| (195) | Exchange Income Corp | Goldman Sachs | 35 | 305 | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Goldman Sachs | (249) |
| (8.255) | Extendicare Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.697 | 1.430 | Ivanhoe Mines Ltd 'A' | Morgan Stanley | (399) |
| (1.034) | Extendicare Inc | Goldman Sachs | 213 | (368) | Jamieson Wellness Inc | Bank of America Merrill Lynch | 451 |
| (108) | Fairfax Financial Holdings Ltd | Morgan Stanley | 329 | (272) | Jamieson Wellness Inc | Goldman Sachs | 333 |
| (1.338) | Fiera Capital Corp | Bank of America Merrill Lynch | 820 | (63) | K92 Mining Inc | Goldman Sachs | 22 |
| (517) | Fiera Capital Corp | Goldman Sachs | 317 | 582 | Kelt Exploration Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 51 |
| (1.012) | Filo Mining Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.798 | 3.295 | Kelt Exploration Ltd | Goldman Sachs | 290 |
| (897) | Filo Mining Corp | Goldman Sachs | 1.594 | (1.263) | Killam Apartment (REIT) | Goldman Sachs | 695 |
| (6.728) | Finning International Inc | Morgan Stanley | 2.173 | (18) | Kinaxis Inc | Morgan Stanley | (15) |
| 2.267 | First Majestic Silver Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.598) | 646 | Kinross Gold Corp | Morgan Stanley | (218) |
| 3.292 | First Majestic Silver Corp | Goldman Sachs | (2.320) | (897) | Labrador Iron Ore Royalty Corp | Bank of America Merrill Lynch | (146) |
| 6.719 | First Majestic Silver Corp | Morgan Stanley | (2.812) | (850) | Labrador Iron Ore Royalty Corp | Goldman Sachs | (132) |
| 64 | First National Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (59) | (1) | Lassonde Industries Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (4) |
| 1.989 | First Quantum Minerals Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (5.608) | 295 | Laurentian Bank of Canada | Bank of America Merrill Lynch | (227) |
| 1.169 | First Quantum Minerals Ltd | Goldman Sachs | (3.296) | 1.065 | Laurentian Bank of Canada | Goldman Sachs | (821) |
| 91 | FirstService Corp | Bank of America Merrill Lynch | (84) | (2.991) | Lightspeed Commerce Inc | Goldman Sachs | 2.394 |
| 129 | FirstService Corp | Goldman Sachs | (119) | (420) | Lightspeed Commerce Inc | Morgan Stanley | (15) |
| 216 | FirstService Corp | Morgan Stanley | 587 | (133) | Linamar Corp | Bank of America Merrill Lynch | 468 |
| 4.898 | Fortuna Silver Mines Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.007) | (115) | Linamar Corp | Goldman Sachs | 404 |
| 2.981 | Fortuna Silver Mines Inc | Goldman Sachs | (613) | 785 | Lithium Americas Corp | Bank of America Merrill Lynch | (801) |
| 153 | Franco-Nevada Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.951) | 1.107 | Lithium Americas Corp | Goldman Sachs | (1.130) |
| 231 | Franco-Nevada Corp | Morgan Stanley | (1.442) | 322 | Lithium Americas Corp | Morgan Stanley | (577) |
| (188) | Frontera Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | (51) | (890) | Loblaw Cos Ltd | Morgan Stanley | (46) |
| (444) | Frontera Energy Corp | Goldman Sachs | (121) | 714 | Lundin Gold Inc | Bank of America Merrill Lynch | (828) |
| (80) | GDI Integrated Facility Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | 102 | 842 | Lundin Gold Inc | Goldman Sachs | (977) |
| (1.003) | George Weston Ltd | Morgan Stanley | 3.041 | (1.794) | MAG Silver Corp | Goldman Sachs | 66 |
| 224 | GFL Environmental Inc | Bank of America Merrill Lynch | (110) | 53 | Major Drilling Group International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (39) |
| 72 | GFL Environmental Inc | Goldman Sachs | (35) | 48 | Major Drilling Group International Inc | Goldman Sachs | (35) |
| 747 | GFL Environmental Inc | Morgan Stanley | 154 | (1.391) | Maple Leaf Foods Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.155 |
| 1.026 | Gildan Activewear Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.757) | (1.495) | Maple Leaf Foods Inc | Goldman Sachs | 2.316 |
| 399 | Gildan Activewear Inc | Goldman Sachs | (1.072) | (143) | Martinrea International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 85 |
| 2.591 | Gildan Activewear Inc | Morgan Stanley | (2.321) | (37) | Martinrea International Inc | Goldman Sachs | 22 |
| 722 | H&R (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (159) | 1.041 | Methanex Corp | Goldman Sachs | (1.422) |
| 4.785 | H&R (REIT) | Goldman Sachs | (955) | 1.684 | Methanex Corp | Morgan Stanley | (3.091) |
| (1.682) | Headwater Exploration Inc | Bank of America Merrill Lynch | 62 | (198) | Metro Inc | Bank of America Merrill Lynch | 798 |
| (3.266) | Headwater Exploration Inc | Goldman Sachs | 120 | (284) | Metro Inc | Goldman Sachs | 1.145 |
| 3.517 | Hudbay Minerals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.272) | (280) | MTY Food Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 730 |
| 6.204 | Hudbay Minerals Inc | Goldman Sachs | (4.008) | (11) | MTY Food Group Inc | Goldman Sachs | 29 |
| (1.416) | iA Financial Corp Inc | Morgan Stanley | 759 | (146) | Mullen Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (17) |
| (326) | IGM Financial Inc | Morgan Stanley | (69) | (353) | Mullen Group Ltd | Goldman Sachs | (11) |
| 430 | Imperial Oil Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (57) | (1.546) | National Bank of Canada | Morgan Stanley | 1.907 |
| 669 | Imperial Oil Ltd | Goldman Sachs | (88) | (286) | Neighbourly Pharmacy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 130 |
| 387 | Imperial Oil Ltd | Morgan Stanley | (776) | 1.440 | New Gold Inc | Bank of America Merrill Lynch | (338) |
| 3.777 | Innergex Renewable Energy Inc | Goldman Sachs | 666 | 2.416 | New Gold Inc | Goldman Sachs | (568) |
| (1.630) | Intact Financial Corp | Morgan Stanley | 5.529 | (1.002) | Newcrest Mining Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.442 |
| 480 | Interfor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (609) | (222) | Newcrest Mining Ltd | Morgan Stanley | 169 |
| 324 | Interfor Corp | Goldman Sachs | (416) | 744 | NFI Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (546) |
| (751) | InterRent (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 391 | 784 | NFI Group Inc | Goldman Sachs | (576) |
| | | | | (1.120) | North West Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (247) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|----------------------------------|---|---------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| (684) | North West Co Inc | Goldman Sachs | (151) | (99) | Quebecor Inc 'B' | Bank of America | |
| (63) | NorthWest Healthcare Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 27 | (273) | Quebecor Inc 'B' | Merrill Lynch | 99 |
| (3.620) | NorthWest Healthcare Properties (REIT) | Goldman Sachs | 1.568 | (822) | Quebecor Inc 'B' | Goldman Sachs | 273 |
| 236 | Novagold Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | (97) | 328 | Restaurant Brands International Inc | Morgan Stanley | 260 |
| 3.133 | Novagold Resources Inc | Goldman Sachs | (1.288) | 63 | Richelieu Hardware Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (111) |
| (43) | Nutrien Ltd | Goldman Sachs | 263 | 735 | Richelieu Hardware Ltd | Goldman Sachs | (1.295) |
| (569) | Nutrien Ltd | Morgan Stanley | 3.151 | 1.844 | RioCan (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.070) |
| (193) | Nuvei Corp | Bank of America Merrill Lynch | 584 | 1.192 | RioCan (REIT) | Goldman Sachs | (691) |
| (95) | Nuvei Corp | Goldman Sachs | 287 | 967 | RioCan (REIT) | Morgan Stanley | (256) |
| (1.870) | Nuvei Corp | Morgan Stanley | 3.007 | (3.513) | Rogers Communications Inc 'B' | Goldman Sachs | 15.527 |
| 288 | NuVista Energy Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (93) | (128) | Rogers Communications Inc 'B' | Morgan Stanley | 401 |
| 239 | NuVista Energy Ltd | Goldman Sachs | (77) | 1.573 | Rogers Sugar Inc | Bank of America Merrill Lynch | (323) |
| (2.676) | OceanaGold Corp | Goldman Sachs | 472 | 895 | Rogers Sugar Inc | Goldman Sachs | (184) |
| (3.236) | Open Text Corp | Goldman Sachs | (3.700) | 202 | Royal Bank of Canada | Morgan Stanley | (476) |
| (2.421) | Open Text Corp | Morgan Stanley | (2.534) | 1.041 | Russel Metals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (103) |
| (875) | Orla Mining Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 514 | 769 | Russel Metals Inc | Goldman Sachs | (65) |
| (647) | Orla Mining Ltd | Goldman Sachs | 380 | 2.047 | Sandstorm Gold Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.112) |
| 314 | Ovintiv Inc | Bank of America Merrill Lynch | (85) | 2.600 | Sandstorm Gold Ltd | Goldman Sachs | (1.413) |
| 920 | Ovintiv Inc | Goldman Sachs | (653) | (4.676) | Saputo Inc | Morgan Stanley | 446 |
| 875 | Ovintiv Inc | Morgan Stanley | (2.666) | 720 | Savaria Corp | Bank of America Merrill Lynch | (275) |
| 373 | Pan American Silver Corp | Bank of America Merrill Lynch | (567) | 1.001 | Savaria Corp | Goldman Sachs | (382) |
| 729 | Pan American Silver Corp | Goldman Sachs | (1.108) | (1.101) | Seabridge Gold Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.053 |
| 1.178 | Pan American Silver Corp | Morgan Stanley | (899) | (436) | Seabridge Gold Inc | Goldman Sachs | 623 |
| (152) | Paramount Resources Ltd 'A' | Morgan Stanley | 209 | 1.186 | Secure Energy Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (165) |
| (396) | Park Lawn Corp | Bank of America Merrill Lynch | 579 | 1.108 | Secure Energy Services Inc | Goldman Sachs | (155) |
| (238) | Park Lawn Corp | Goldman Sachs | 257 | (4.332) | Sienna Senior Living Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.657 |
| (263) | Parkland Corp | Bank of America Merrill Lynch | 141 | (951) | Sienna Senior Living Inc | Goldman Sachs | 391 |
| (211) | Parkland Corp | Goldman Sachs | 113 | 5 | Silvercorp Metals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2) |
| (6.413) | Parkland Corp | Morgan Stanley | 8.616 | 4.851 | Silvercorp Metals Inc | Goldman Sachs | (2.351) |
| 1.719 | Pason Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (88) | (1.595) | SilverCrest Metals Inc | Goldman Sachs | 925 |
| 1.380 | Pason Systems Inc | Goldman Sachs | (71) | (4.437) | Skeena Resources Ltd | Goldman Sachs | 4.365 |
| 161 | Pembina Pipeline Corp | Bank of America Merrill Lynch | (67) | 2.052 | Slate Grocery 'U' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (829) |
| 151 | Pembina Pipeline Corp | Goldman Sachs | (252) | 1.417 | Slate Grocery 'U' (REIT) | Goldman Sachs | (572) |
| 654 | Pembina Pipeline Corp | Morgan Stanley | (264) | 729 | Sleep Country Canada Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (182) |
| (1.625) | Pet Valu Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.401 | 369 | Sleep Country Canada Holdings Inc | Goldman Sachs | (92) |
| (222) | Peyto Exploration & Development Corp | Morgan Stanley | 125 | (902) | SmartCentres (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 563 |
| (7.219) | Pipestone Energy Corp | Goldman Sachs | 1.537 | (136) | SmartCentres (REIT) | Goldman Sachs | 85 |
| (327) | Pollard Banknote Ltd | Goldman Sachs | 544 | (1.891) | SNC-Lavalin Group Inc | Morgan Stanley | 1.749 |
| (4.182) | Power Corp of Canada | Morgan Stanley | 599 | (2.925) | Spartan Delta Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.964 |
| 348 | PrairieSky Royalty Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (61) | (4.170) | Spartan Delta Corp | Goldman Sachs | 4.225 |
| 3.505 | PrairieSky Royalty Ltd | Goldman Sachs | (618) | 157 | Spin Master Corp | Bank of America Merrill Lynch | (231) |
| 134 | Precision Drilling Corp | Bank of America Merrill Lynch | (555) | 293 | Spin Master Corp | Goldman Sachs | (430) |
| 592 | Precision Drilling Corp | Goldman Sachs | (2.451) | 344 | SSR Mining Inc | Bank of America Merrill Lynch | (624) |
| (413) | Premium Brands Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (913) | 675 | SSR Mining Inc | Goldman Sachs | (1.224) |
| (221) | Premium Brands Holdings Corp | Goldman Sachs | (488) | 395 | SSR Mining Inc | Morgan Stanley | (389) |
| 154 | Primo Water Corp | Bank of America Merrill Lynch | (179) | 773 | Stantec Inc | Bank of America Merrill Lynch | (45) |
| 1.589 | Primo Water Corp | Goldman Sachs | (1.843) | 1.000 | Stantec Inc | Goldman Sachs | (59) |
| 207 | Primo Water Corp | Morgan Stanley | (157) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|-------------------------------------|-----------------|---|---------------------------|--------------------------------|-----------------|---|
| Kanada Fortsetzung | | | | Kanada Fortsetzung | | | |
| 1.746 | Stantec Inc | Morgan Stanley | 1.346 | (471) | Winpak Ltd | Bank of America | |
| (202) | Stella-Jones Inc | Bank of America | | | Merrill Lynch | | 1.024 |
| | | Merrill Lynch | (171) | (1.089) | Winpak Ltd | Goldman Sachs | 2.367 |
| (2.456) | StorageVault Canada Inc | Bank of America | | (479) | WSP Global Inc | Morgan Stanley | 890 |
| | | Merrill Lynch | 288 | | | | (3.888) |
| (7.143) | StorageVault Canada Inc | Goldman Sachs | 839 | Kaimaninseln | | | |
| (166) | Sun Life Financial Inc | Goldman Sachs | 82 | (32) | SMART Global Holdings Inc | Bank of America | |
| (453) | Sun Life Financial Inc | Morgan Stanley | 417 | | Merrill Lynch | | (183) |
| 1.720 | SunOpta Inc | Bank of America | | (413) | SMART Global Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.362) |
| | | Merrill Lynch | (1.553) | | | | (2.545) |
| 536 | SunOpta Inc | Goldman Sachs | (484) | Dänemark | | | |
| 1.346 | Superior Plus Corp | Bank of America | | (546) | ALK-Abello A/S | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (593) | | | Merrill Lynch | 368 |
| 757 | Superior Plus Corp | Goldman Sachs | (333) | (26.799) | Alm Brand A/S | Bank of America | |
| (915) | Surge Energy Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 527 |
| | | Merrill Lynch | 94 | (2) | AP Moller - Maersk A/S 'A' | Bank of America | |
| (32.979) | Tamarack Valley Energy Ltd | Morgan Stanley | 7.143 | | | Merrill Lynch | 95 |
| 4.971 | Taseko Mines Ltd | Bank of America | | (1) | AP Moller - Maersk A/S 'A' | Morgan Stanley | (9) |
| | | Merrill Lynch | (1.204) | (1) | AP Moller - Maersk A/S 'B' | Bank of America | |
| 11.190 | Taseko Mines Ltd | Goldman Sachs | (2.711) | | | Merrill Lynch | 59 |
| 621 | TC Energy Corp | Goldman Sachs | (1.386) | (1.280) | Bavarian Nordic A/S | Bank of America | |
| 1.562 | TC Energy Corp | Morgan Stanley | (1.330) | | | Merrill Lynch | 4.294 |
| 447 | Teck Resources Ltd 'B' | Bank of America | | (146) | Carlsberg AS 'B' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (427) | | | Merrill Lynch | 1.779 |
| 798 | Teck Resources Ltd 'B' | Goldman Sachs | (2.575) | (333) | Chemometec A/S | Bank of America | |
| 603 | Teck Resources Ltd 'B' | Morgan Stanley | (863) | | | Merrill Lynch | (1.792) |
| 1.154 | TELUS Corp | Bank of America | | 385 | D/S Norden A/S | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.415) | | | Merrill Lynch | 276 |
| 2.601 | TELUS Corp | Goldman Sachs | (3.189) | 392 | D/S Norden A/S | Goldman Sachs | 281 |
| 4.188 | TELUS Corp | Morgan Stanley | (2.644) | 43 | D/S Norden A/S | Morgan Stanley | 69 |
| (1.831) | Timbercreek Financial Corp | Bank of America | | (2.220) | Danske Bank A/S | Morgan Stanley | (32) |
| | | Merrill Lynch | 591 | (28) | Dfds A/S | Bank of America | |
| 642 | Topaz Energy Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (4) |
| | | Merrill Lynch | 419 | (245) | DSV A/S | Morgan Stanley | 70 |
| 1.336 | Topaz Energy Corp | Goldman Sachs | 873 | 27 | Genmab A/S | Bank of America | |
| 692 | Torex Gold Resources Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (584) |
| | | Merrill Lynch | 81 | 48 | Genmab A/S | Goldman Sachs | (1.039) |
| 781 | Torex Gold Resources Inc | Goldman Sachs | 92 | 8 | Genmab A/S | Morgan Stanley | (206) |
| (1.762) | Toromont Industries Ltd | Morgan Stanley | 9.625 | (301) | GN Store Nord AS | Morgan Stanley | 240 |
| (187) | Toronto-Dominion Bank | Goldman Sachs | 540 | 1.344 | H Lundbeck A/S | Bank of America | |
| (40) | Toronto-Dominion Bank | Morgan Stanley | 16 | | | Merrill Lynch | (139) |
| 662 | Tourmaline Oil Corp | Bank of America | | 121 | H Lundbeck A/S | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (587) | | | Merrill Lynch | (50) |
| 756 | Tourmaline Oil Corp | Goldman Sachs | (501) | 4.521 | H Lundbeck A/S | Goldman Sachs | (467) |
| 1.089 | Tourmaline Oil Corp | Morgan Stanley | (2.733) | 245 | H Lundbeck A/S | Goldman Sachs | (88) |
| 1.567 | TransAlta Corp | Bank of America | | 7.449 | H Lundbeck A/S | Morgan Stanley | (2.990) |
| | | Merrill Lynch | (316) | 307 | Jyske Bank A/S Reg | Goldman Sachs | 426 |
| 649 | TransAlta Corp | Goldman Sachs | (131) | 63 | Jyske Bank A/S Reg | Morgan Stanley | 9 |
| 670 | TransAlta Corp | Morgan Stanley | (66) | (143) | Matas A/S | Bank of America | |
| 1.342 | TransAlta Renewables Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 135 |
| | | Merrill Lynch | 74 | 188 | Netcompany Group A/S | Bank of America | |
| 2.430 | TransAlta Renewables Inc | Goldman Sachs | 134 | | | Merrill Lynch | 539 |
| 144 | Transcontinental Inc 'A' | Bank of America | | 39 | Netcompany Group A/S | Goldman Sachs | 112 |
| | | Merrill Lynch | (81) | 164 | NKT A/S | Bank of America | |
| (3.039) | Tricon Residential Inc | Goldman Sachs | 625 | | | Merrill Lynch | 1.293 |
| (567) | Trisura Group Ltd | Bank of America | | 64 | Novo Nordisk A/S 'B' | Morgan Stanley | (569) |
| | | Merrill Lynch | 956 | 376 | Novozymes A/S 'B' | Bank of America | |
| (89) | Trisura Group Ltd | Goldman Sachs | 160 | | | Merrill Lynch | (1.391) |
| (360) | Victoria Gold Corp | Goldman Sachs | 275 | 764 | Novozymes A/S 'B' | Goldman Sachs | (2.826) |
| 91 | Wesdome Gold Mines Ltd | Bank of America | | 993 | Novozymes A/S 'B' | Morgan Stanley | (3.217) |
| | | Merrill Lynch | (87) | (63) | NTG Nordic Transport Group A/S | Bank of America | |
| (295) | Westshore Terminals Investment Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (23) |
| | | Merrill Lynch | (425) | (295) | NTG Nordic Transport Group A/S | Goldman Sachs | (106) |
| (650) | Westshore Terminals Investment Corp | Goldman Sachs | (935) | 25 | Orsted AS | Bank of America | |
| 238 | Wheaton Precious Metals Corp | Merrill Lynch | (1.429) | | | Merrill Lynch | (173) |
| 99 | Wheaton Precious Metals Corp | Goldman Sachs | (595) | 139 | Orsted AS | Goldman Sachs | (960) |
| 739 | Wheaton Precious Metals Corp | Morgan Stanley | (1.139) | 298 | Orsted AS | Morgan Stanley | (1.273) |
| | | | | 32 | Per Aarsleff Holding A/S | Goldman Sachs | (22) |
| | | | | (351) | Ringkjoebing Landbobank A/S | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (624) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---|-----------------------------|-----------------------|-------------------------------|---|
| Dänemark Fortsetzung | | | | Finnland Fortsetzung | | | |
| 20 | ROCKWOOL A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (231) | 453 | Kone Oyj 'B' | Goldman Sachs | (1.625) |
| 101 | ROCKWOOL A/S 'B' | Goldman Sachs | (1.166) | 178 | Kone Oyj 'B' | Morgan Stanley | (449) |
| 144 | ROCKWOOL A/S 'B' | Morgan Stanley | (2.261) | (729) | Konecranes Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 3.137 |
| (101) | Royal Unibrew A/S | Bank of America Merrill Lynch | 660 | (446) | Konecranes Oyj | Goldman Sachs | 1.919 |
| (55) | Royal Unibrew A/S | Morgan Stanley | 352 | (1.306) | Metsa Board Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (488) |
| 685 | Scandinavian Tobacco Group A/S | Bank of America Merrill Lynch | (1.070) | (2.569) | Metsa Board Oyj 'B' | Goldman Sachs | (960) |
| 1.054 | Scandinavian Tobacco Group A/S | Goldman Sachs | (1.647) | 2.013 | Metso Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (1.311) |
| 30 | Schow & Co A/S | Bank of America Merrill Lynch | (73) | 1.022 | Metso Oyj | Morgan Stanley | (688) |
| 88 | Schow & Co A/S | Goldman Sachs | (214) | (58) | Musti Group Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 63 |
| (122) | SimCorp A/S | Bank of America Merrill Lynch | 166 | (33) | Musti Group Oyj | Goldman Sachs | 36 |
| (52) | Solar A/S 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 186 | 3.422 | Nokian Renkaat Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (2.726) |
| 342 | Sydbank AS | Bank of America Merrill Lynch | 70 | 1.634 | Nokian Renkaat Oyj | Goldman Sachs | (1.228) |
| 589 | Sydbank AS | Goldman Sachs | 127 | (271) | Oriola Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 17 |
| (874) | Topdanmark AS | Bank of America Merrill Lynch | (900) | (79) | Oriola Oyj 'B' | Goldman Sachs | 5 |
| (17) | Trifork Holding AG | Goldman Sachs | 18 | 94 | Orion Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (223) |
| (382) | Vestas Wind Systems A/S | Bank of America Merrill Lynch | 412 | 130 | Orion Oyj 'B' | Goldman Sachs | (308) |
| (1.190) | Vestas Wind Systems A/S | Morgan Stanley | 1.592 | 227 | Orion Oyj 'B' | Morgan Stanley | (400) |
| (791) | Zealand Pharma A/S | Bank of America Merrill Lynch | (499) | 717 | Outokumpu Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (406) |
| | | | (12.490) | 1.873 | Outokumpu Oyj | Goldman Sachs | (690) |
| | | | | 2.803 | Outokumpu Oyj | Morgan Stanley | (695) |
| | | | | 191 | Revenio Group Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (543) |
| | | | | 133 | Revenio Group Oyj | Goldman Sachs | (378) |
| | | | | (1.301) | Sanoma Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 903 |
| (460) | Aktia Bank Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (44) | (203) | Sanoma Oyj | Goldman Sachs | 141 |
| (1.030) | Aktia Bank Oyj | Goldman Sachs | (99) | (840) | Stora Enso Oyj 'R' | Goldman Sachs | (67) |
| (32) | Anora Group Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 14 | (304) | Stora Enso Oyj 'R' | Morgan Stanley | (81) |
| (51) | Anora Group Oyj | Goldman Sachs | 23 | (170) | Talenom Oyj | Goldman Sachs | — |
| 116 | Cargotec Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (478) | (406) | TietoEVRY Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 520 |
| 239 | Cargotec Oyj | Goldman Sachs | (930) | (1.197) | TietoEVRY Oyj | Goldman Sachs | 1.534 |
| 3.492 | Citycon Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (410) | (1.911) | Tokmanni Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.041 |
| 6.746 | Citycon Oyj | Goldman Sachs | (792) | (2.863) | Tokmanni Group Corp | Goldman Sachs | 1.559 |
| (1.102) | Elisa Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 3.954 | 510 | Uponor Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 304 |
| (724) | Elisa Oyj | Morgan Stanley | 1.979 | 353 | Uponor Oyj | Goldman Sachs | 346 |
| 1.678 | Finnair Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 68 | (152) | Valmet Oyj | Bank of America Merrill Lynch | 373 |
| 1.076 | Finnair Oyj | Goldman Sachs | 44 | (265) | Valmet Oyj | Goldman Sachs | 651 |
| (239) | Fortum Oyj | Goldman Sachs | 381 | (352) | Valmet Oyj | Morgan Stanley | 801 |
| (1.060) | Fortum Oyj | Morgan Stanley | 668 | 751 | Wartsila Oyj Abp | Bank of America Merrill Lynch | (425) |
| 477 | F-Secure Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (89) | 8.568 | Wartsila Oyj Abp | Goldman Sachs | (4.849) |
| 668 | F-Secure Oyj | Goldman Sachs | (125) | 3.510 | Wartsila Oyj Abp | Morgan Stanley | (1.724) |
| (31) | Huhtamaki Oyj | Goldman Sachs | 72 | 1.021 | YIT Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (270) |
| (249) | Huhtamaki Oyj | Morgan Stanley | 609 | 1.403 | YIT Oyj | Goldman Sachs | (372) |
| 1.837 | Kemira Oyj | Bank of America Merrill Lynch | (953) | | | | (1.436) |
| 951 | Kemira Oyj | Goldman Sachs | (473) | Frankreich | | | |
| 29 | Kempower Oyj | Goldman Sachs | (72) | 1.420 | Accor SA | Morgan Stanley | (2.229) |
| (961) | Kesko Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 1.052 | 98 | Aeroports de Paris | Bank of America Merrill Lynch | 513 |
| (2) | Kesko Oyj 'B' | Goldman Sachs | 2 | 47 | Aeroports de Paris | Goldman Sachs | 246 |
| (3.461) | Kesko Oyj 'B' | Morgan Stanley | 1.811 | 45 | Aeroports de Paris | Morgan Stanley | (106) |
| (287) | Kojamo Oyj | Goldman Sachs | 195 | 3.020 | Air France-KLM | Goldman Sachs | 184 |
| (1.678) | Kojamo Oyj | Morgan Stanley | 1.263 | (92) | Airbus SE | Goldman Sachs | (71) |
| 432 | Kone Oyj 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (1.550) | (450) | Alstom SA | Morgan Stanley | 822 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|--|-------------------------------|---|-------------------------------|------------------------------|-------------------------------|---|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| (16) | Altea SCA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 7 | (795) | Derichebourg SA | Bank of America Merrill Lynch | 474 |
| (150) | Altea SCA (REIT) | Goldman Sachs | 64 | (1.401) | Derichebourg SA | Goldman Sachs | 1.076 |
| (77) | Alten SA | Bank of America Merrill Lynch | 551 | 316 | Edenred | Bank of America Merrill Lynch | 540 |
| (172) | Alten SA | Goldman Sachs | 1.230 | 105 | Edenred | Goldman Sachs | 179 |
| (405) | Amundi SA | Bank of America Merrill Lynch | 3.914 | 185 | Edenred | Morgan Stanley | (20) |
| (107) | Amundi SA | Goldman Sachs | 1.034 | (448) | Eiffage SA | Goldman Sachs | 1.478 |
| (639) | Amundi SA | Morgan Stanley | 3.855 | (129) | Eiffage SA | Morgan Stanley | 529 |
| (481) | Antin Infrastructure Partners SA | Bank of America Merrill Lynch | 308 | (511) | Elis SA | Bank of America Merrill Lynch | 720 |
| (974) | Antin Infrastructure Partners SA | Goldman Sachs | 624 | (755) | Elis SA | Goldman Sachs | 1.064 |
| 773 | Atos SE | Bank of America Merrill Lynch | 726 | 926 | Engie SA | Bank of America Merrill Lynch | (680) |
| 1.601 | Atos SE | Goldman Sachs | 1.504 | 720 | Engie SA | Goldman Sachs | (529) |
| 90 | AXA SA | Morgan Stanley | (27) | 5.623 | Engie SA | Morgan Stanley | (2.029) |
| 135 | Believe SA | Bank of America Merrill Lynch | (156) | (254) | Eramet SA | Bank of America Merrill Lynch | 2.102 |
| 73 | Believe SA | Goldman Sachs | (84) | (80) | Eramet SA | Goldman Sachs | 662 |
| (424) | BioMerieux | Bank of America Merrill Lynch | 1.983 | (213) | Eramet SA | Morgan Stanley | 2.263 |
| (111) | BioMerieux | Goldman Sachs | 519 | 27 | Esker SA | Bank of America Merrill Lynch | 112 |
| (551) | BioMerieux | Morgan Stanley | 4.071 | 64 | Esker SA | Goldman Sachs | 267 |
| 442 | Bureau Veritas SA | Bank of America Merrill Lynch | (340) | (89) | Eurazeo SE | Goldman Sachs | 9 |
| 569 | Bureau Veritas SA | Goldman Sachs | (437) | (225) | Eurazeo SE | Morgan Stanley | 60 |
| 1.306 | Bureau Veritas SA | Morgan Stanley | (1.213) | (800) | Euroapi SA | Bank of America Merrill Lynch | 645 |
| (211) | Capgemini SE | Morgan Stanley | 158 | (2.004) | Euroapi SA | Goldman Sachs | 1.616 |
| (633) | Carmila SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (270) | (401) | Eurofins Scientific SE | Bank of America Merrill Lynch | (831) |
| (257) | Carmila SA (REIT) | Goldman Sachs | (110) | (1.009) | Eurofins Scientific SE | Goldman Sachs | (2.090) |
| 1.148 | Carrefour SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.250) | (447) | Eurofins Scientific SE | Morgan Stanley | (830) |
| 2.070 | Carrefour SA | Goldman Sachs | (2.137) | (265) | Euronext NV | Bank of America Merrill Lynch | 2.066 |
| 1.924 | Carrefour SA | Morgan Stanley | (1.175) | (261) | Euronext NV | Goldman Sachs | 2.034 |
| (14.418) | CGG SA | Goldman Sachs | 413 | (609) | Euronext NV | Morgan Stanley | 3.154 |
| (494) | Chargeurs SA | Bank of America Merrill Lynch | 670 | 4.073 | Eutelsat Communications SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.587) |
| (490) | Chargeurs SA | Goldman Sachs | 702 | 1.888 | Eutelsat Communications SA | Goldman Sachs | (736) |
| 168 | Cie de Saint-Gobain | Morgan Stanley | (556) | (394) | Fnac Darty SA | Bank of America Merrill Lynch | 326 |
| 109 | Cie des Alpes | Bank of America Merrill Lynch | (84) | (350) | Fnac Darty SA | Goldman Sachs | 351 |
| 266 | Cie des Alpes | Goldman Sachs | (205) | 22 | Gaztransport Et Technigaz SA | Bank of America Merrill Lynch | (109) |
| 372 | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Bank of America Merrill Lynch | (191) | 281 | Gaztransport Et Technigaz SA | Goldman Sachs | (1.395) |
| 218 | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Goldman Sachs | (190) | 411 | Gaztransport Et Technigaz SA | Morgan Stanley | (1.163) |
| 414 | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | Morgan Stanley | (201) | 1.176 | Getlink SE | Morgan Stanley | (1.645) |
| 739 | Cie Plastic Omnium SA | Bank of America Merrill Lynch | (87) | 40 | Hermes International | Bank of America Merrill Lynch | (2.883) |
| 808 | Cie Plastic Omnium SA | Goldman Sachs | (95) | 37 | Hermes International | Goldman Sachs | (2.647) |
| (1.428) | Coface SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.490 | 44 | Hermes International | Morgan Stanley | (5.182) |
| (3.767) | Coface SA | Goldman Sachs | 2.610 | 856 | ICADE (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2.907) |
| (67) | Covivio SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 173 | 806 | ICADE (REIT) | Goldman Sachs | (2.737) |
| (7.547) | Credit Agricole SA | Goldman Sachs | 7.607 | 1.410 | ICADE (REIT) | Morgan Stanley | (2.830) |
| (1.508) | Credit Agricole SA | Morgan Stanley | 1.916 | (18) | ID Logistics Group | Bank of America Merrill Lynch | 229 |
| 148 | Danone SA | Bank of America Merrill Lynch | (301) | (9) | ID Logistics Group | Goldman Sachs | 159 |
| 884 | Danone SA | Goldman Sachs | (2.961) | (848) | Imerys SA | Bank of America Merrill Lynch | (5) |
| 1.313 | Danone SA | Morgan Stanley | (4.052) | (1.378) | Imerys SA | Goldman Sachs | — |
| 45 | Dassault Aviation SA | Bank of America Merrill Lynch | (471) | 194 | Interparfums SA | Bank of America Merrill Lynch | (592) |
| | | | | 245 | Interparfums SA | Goldman Sachs | (738) |
| | | | | (134) | Ipsen SA | Bank of America Merrill Lynch | 501 |
| | | | | (414) | Ipsen SA | Goldman Sachs | 1.547 |
| | | | | (144) | Ipsen SA | Morgan Stanley | 938 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---|-------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---|
| Frankreich Fortsetzung | | | | Frankreich Fortsetzung | | | |
| 131 | IPSOS | Bank of America Merrill Lynch | (246) | 81 | SES-imagotag SA | Goldman Sachs | 450 |
| 314 | IPSOS | Goldman Sachs | (590) | 1.470 | SMCP SA | Bank of America Merrill Lynch | (942) |
| 8 | Kering SA | Bank of America Merrill Lynch | (455) | 1.424 | SMCP SA | Goldman Sachs | (912) |
| 7 | Kering SA | Morgan Stanley | (328) | (327) | Societe BIC SA | Bank of America Merrill Lynch | 733 |
| 241 | Klepierre SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (103) | (305) | Societe BIC SA | Goldman Sachs | 684 |
| 433 | Klepierre SA (REIT) | Goldman Sachs | (185) | (97) | Sodexo SA | Goldman Sachs | (178) |
| 2.891 | Klepierre SA (REIT) | Morgan Stanley | 278 | (27) | Sodexo SA | Morgan Stanley | 26 |
| 583 | Korian SA | Bank of America Merrill Lynch | (246) | (38) | Sopra Steria Group SACA | Bank of America Merrill Lynch | 584 |
| 879 | Korian SA | Goldman Sachs | (371) | (101) | Sopra Steria Group SACA | Goldman Sachs | 1.553 |
| (741) | La Francaise des Jeux SAEM | Morgan Stanley | 1.630 | (1.045) | STMicroelectronics NV | Bank of America Merrill Lynch | (2.511) |
| (32) | Legrand SA | Goldman Sachs | (83) | (612) | STMicroelectronics NV | Goldman Sachs | (1.470) |
| (68) | Legrand SA | Morgan Stanley | (61) | (1.738) | STMicroelectronics NV | Morgan Stanley | 1.512 |
| (111) | LISI | Goldman Sachs | 68 | 272 | Television Francaise 1 | Bank of America Merrill Lynch | (89) |
| (13) | L'Oreal SA | Goldman Sachs | 60 | 5.217 | Television Francaise 1 | Goldman Sachs | (3.407) |
| (39) | L'Oreal SA | Morgan Stanley | 797 | (14) | Thales SA | Bank of America Merrill Lynch | 115 |
| 36 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Morgan Stanley | (2.441) | (58) | Thales SA | Goldman Sachs | 477 |
| (489) | Maisons du Monde SA | Bank of America Merrill Lynch | 360 | (74) | Thales SA | Morgan Stanley | 672 |
| (253) | Maisons du Monde SA | Goldman Sachs | 186 | (1.357) | TotalEnergies SE | Goldman Sachs | 4.637 |
| 525 | Mercialys SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (252) | (81) | Trigano SA | Bank of America Merrill Lynch | (311) |
| 979 | Mercialys SA (REIT) | Goldman Sachs | (470) | (159) | Trigano SA | Goldman Sachs | (611) |
| 82 | Mersen SA | Bank of America Merrill Lynch | (219) | (286) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 559 |
| 209 | Mersen SA | Goldman Sachs | (558) | (829) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | Goldman Sachs | 1.620 |
| (662) | Metropole Television SA | Bank of America Merrill Lynch | 271 | (1.096) | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | Morgan Stanley | 1.240 |
| (824) | Metropole Television SA | Goldman Sachs | 387 | 563 | Vallourec SA | Bank of America Merrill Lynch | (307) |
| 1.555 | Neoen SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.063) | (511) | Valneva SE | Bank of America Merrill Lynch | 52 |
| 1.480 | Neoen SA | Goldman Sachs | (1.011) | 4.535 | Veolia Environnement SA | Bank of America Merrill Lynch | 649 |
| 1.375 | Neoen SA | Morgan Stanley | 323 | 1.998 | Veolia Environnement SA | Goldman Sachs | 683 |
| 338 | Nexity SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.243) | 1.346 | Veolia Environnement SA | Morgan Stanley | (257) |
| 489 | Nexity SA | Goldman Sachs | (2.322) | 473 | Verallia SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.220) |
| 83 | Pernod Ricard SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.134) | 373 | Verallia SA | Goldman Sachs | (1.036) |
| 134 | Pernod Ricard SA | Morgan Stanley | (1.731) | 126 | Vicat SA | Bank of America Merrill Lynch | (155) |
| (342) | Publicis Groupe SA | Bank of America Merrill Lynch | (139) | 860 | Vicat SA | Goldman Sachs | (1.056) |
| (34) | Publicis Groupe SA | Morgan Stanley | 86 | 89 | Vilmorin & Cie SA | Bank of America Merrill Lynch | (25) |
| (226) | Quadiant SA | Bank of America Merrill Lynch | (63) | 52 | Vilmorin & Cie SA | Goldman Sachs | (9) |
| (87) | Quadiant SA | Goldman Sachs | (24) | (12) | Virbac SA | Bank of America Merrill Lynch | 288 |
| 45 | Remy Cointreau SA | Bank of America Merrill Lynch | (670) | (26) | Virbac SA | Goldman Sachs | 580 |
| 17 | Remy Cointreau SA | Goldman Sachs | (253) | (1.009) | Volitalia SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | (409) |
| 15 | Remy Cointreau SA | Morgan Stanley | (130) | 155 | Wendel SE | Bank of America Merrill Lynch | (331) |
| 590 | Renault SA | Goldman Sachs | (955) | 115 | Wendel SE | Goldman Sachs | (246) |
| 147 | Renault SA | Morgan Stanley | (294) | 383 | Wendel SE | Morgan Stanley | (1.431) |
| 126 | Rexel SA | Bank of America Merrill Lynch | (3) | (419) | Worldline SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.512 |
| (60) | Rubis SCA | Bank of America Merrill Lynch | 11 | (1.011) | Worldline SA | Goldman Sachs | 3.649 |
| (121) | Rubis SCA | Goldman Sachs | 15 | (502) | Worldline SA | Morgan Stanley | 2.476 |
| (173) | Safran SA | Goldman Sachs | 377 | 79 | X-Fab Silicon Foundries SE | Goldman Sachs | (12) |
| (151) | Safran SA | Morgan Stanley | 929 | | | | 3.242 |
| (45) | Sartorius Stedim Biotech | Goldman Sachs | 24 | | | | |
| 311 | Schneider Electric SE | Morgan Stanley | (824) | | | | |
| 1.632 | SES SA | Bank of America Merrill Lynch | (558) | | | | |
| 2.755 | SES SA | Goldman Sachs | (941) | | | | |
| 48 | SES-imagotag SA | Bank of America Merrill Lynch | 267 | | | | |
| | | | | | Deutschland | | |
| | | | | 69 | 1&1 AG | Bank of America Merrill Lynch | (46) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|--|----------------------------------|---|--------------------------------|---|-----------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| 104 | 1&1 AG | Goldman Sachs | (70) | (114) | CompuGroup Medical SE | Bank of America | |
| (1.718) | About You Holding SE | Bank of America Merrill Lynch | 418 | (96) | CompuGroup Medical SE & Co KGaA | Merrill Lynch | (55) |
| (199) | About You Holding SE | Goldman Sachs | 48 | (80) | Continental AG | Goldman Sachs | (43) |
| 63 | Adesso SE | Goldman Sachs | (901) | (119) | Continental AG | Bank of America | |
| (27) | adidas AG | Bank of America Merrill Lynch | 398 | (287) | Continental AG | Merrill Lynch | 349 |
| (211) | adidas AG | Goldman Sachs | 2.346 | 245 | Covestro AG | Goldman Sachs | 518 |
| (61) | adidas AG | Morgan Stanley | 363 | (932) | Covestro AG | Morgan Stanley | 1.526 |
| (295) | ADVA Optical Networking SE | Goldman Sachs | 97 | 820 | Covestro AG | Bank of America | |
| (144) | AIXTRON SE | Bank of America Merrill Lynch | (295) | 245 | CropEnergies AG | Merrill Lynch | (766) |
| (268) | AIXTRON SE | Morgan Stanley | (26) | 132 | CropEnergies AG | Goldman Sachs | (2.916) |
| (2.282) | Aroundtown SA | Bank of America Merrill Lynch | 269 | (728) | CTS Eventim AG & Co KGaA | Morgan Stanley | (2.732) |
| (7.234) | Aroundtown SA | Goldman Sachs | 853 | (90) | CTS Eventim AG & Co KGaA | Bank of America | |
| (8.045) | Aroundtown SA | Morgan Stanley | 596 | (181) | Delivery Hero SE | Merrill Lynch | (389) |
| 127 | Atoss Software AG | Bank of America Merrill Lynch | 1.424 | (424) | Delivery Hero SE | Goldman Sachs | (879) |
| 160 | Atoss Software AG | Goldman Sachs | 1.794 | (722) | Delivery Hero SE | Morgan Stanley | 2.060 |
| 59 | AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | 6 | (391) | Dermapharm Holding SE | Bank of America | 1.210 |
| 92 | AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA | Goldman Sachs | 10 | (628) | Dermapharm Holding SE | Merrill Lynch | (149) |
| (61) | Aurubis AG | Bank of America Merrill Lynch | 332 | 966 | Deutsche Bank AG Reg | Goldman Sachs | (12) |
| (75) | Aurubis AG | Goldman Sachs | 408 | (638) | Deutsche Boerse AG | Goldman Sachs | (260) |
| (62) | Aurubis AG | Morgan Stanley | 226 | (226) | Deutsche Boerse AG | Morgan Stanley | 6.063 |
| (1.116) | Auto1 Group SE | Bank of America Merrill Lynch | (83) | 1.000 | Deutsche Pfandbriefbank AG | Bank of America | 1.388 |
| (1.988) | Auto1 Group SE | Goldman Sachs | (149) | 4.359 | Deutsche Pfandbriefbank AG | Merrill Lynch | (1.052) |
| (50) | Bayer AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 64 | (744) | Deutsche Post AG Reg | Goldman Sachs | (4.584) |
| (582) | Bayer AG Reg | Goldman Sachs | 423 | (388) | Deutsche Wohnen SE | Bank of America | (1.259) |
| (720) | Bayer AG Reg | Morgan Stanley | 871 | (595) | Deutsche Wohnen SE | Merrill Lynch | 472 |
| 79 | Bayerische Motoren Werke AG (Pref) | Goldman Sachs | 127 | 4.238 | Deutz AG | Morgan Stanley | 699 |
| (327) | BayWa AG | Bank of America Merrill Lynch | (122) | 3.909 | Deutz AG | Bank of America | (533) |
| (587) | BayWa AG | Goldman Sachs | (219) | (408) | DIC Asset AG | Merrill Lynch | (493) |
| (640) | Bechtle AG | Bank of America Merrill Lynch | 1.353 | (749) | DIC Asset AG | Goldman Sachs | 418 |
| (738) | Bechtle AG | Goldman Sachs | 1.560 | (8) | Draegerwerk AG & Co KGaA | Bank of America | 768 |
| (1.238) | Bechtle AG | Morgan Stanley | 3.027 | (31) | Draegerwerk AG & Co KGaA | Merrill Lynch | 9 |
| (311) | Befesa SA | Bank of America Merrill Lynch | 1.448 | 24 | Draegerwerk AG & Co KGaA (Pref) | Goldman Sachs | 36 |
| (687) | Befesa SA | Goldman Sachs | 2.861 | 32 | Draegerwerk AG & Co KGaA (Pref) | Bank of America | (73) |
| 318 | Bilfinger SE | Bank of America Merrill Lynch | (661) | 735 | Duerr AG | Merrill Lynch | (106) |
| 391 | Bilfinger SE | Goldman Sachs | (766) | 817 | Duerr AG | Bank of America | (534) |
| (379) | Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | 150 | 560 | DWS Group GmbH & Co KGaA | Goldman Sachs | (593) |
| (264) | Brenntag SE | Bank of America Merrill Lynch | 784 | 503 | DWS Group GmbH & Co KGaA | Bank of America | (84) |
| (156) | Brenntag SE | Goldman Sachs | 425 | 811 | DWS Group GmbH & Co KGaA | Goldman Sachs | (75) |
| (277) | Brenntag SE | Morgan Stanley | 468 | (66) | Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG | Morgan Stanley | (762) |
| (435) | CANCOM SE | Bank of America Merrill Lynch | 225 | (78) | Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG | Bank of America | 495 |
| (770) | CANCOM SE | Goldman Sachs | 384 | (40) | Einhell Germany AG (Pref) | Merrill Lynch | 422 |
| 5 | Carl Zeiss Meditec AG | Bank of America Merrill Lynch | (40) | (114) | Elmos Semiconductor SE | Goldman Sachs | 769 |
| 75 | Carl Zeiss Meditec AG | Goldman Sachs | (601) | 111 | Elmos Semiconductor SE | Bank of America | 142 |
| 21 | Carl Zeiss Meditec AG | Morgan Stanley | (94) | 94 | ElringKlinger AG | Merrill Lynch | 110 |
| (1.184) | CECONOMY AG | Bank of America Merrill Lynch | 298 | 534 | ElringKlinger AG | Bank of America | (422) |
| (2.762) | CECONOMY AG | Goldman Sachs | 696 | 1.318 | ElringKlinger AG | Goldman Sachs | (1.041) |
| (1) | Cewe Stiftung & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | 5 | | | | |
| (2) | Cewe Stiftung & Co KGaA | Goldman Sachs | 11 | | | | |
| 1.151 | Commerzbank AG | Morgan Stanley | (187) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|---|----------------------------------|---|--------------------------------|---|----------------------------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| 491 | Encavis AG | Bank of America Merrill Lynch | (527) | 373 | Hensoldt AG | Bank of America Merrill Lynch | (886) |
| 1.351 | Encavis AG | Goldman Sachs | (1.450) | 359 | Hensoldt AG | Goldman Sachs | (791) |
| 1.533 | Encavis AG | Morgan Stanley | (1.105) | (164) | HOCHTIEF AG | Goldman Sachs | (411) |
| (84) | Energiekontor AG | Bank of America Merrill Lynch | 526 | (80) | HOCHTIEF AG | Morgan Stanley | (115) |
| (59) | Energiekontor AG | Goldman Sachs | 454 | 49 | Hornbach Holding AG & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | (500) |
| 865 | Evonik Industries AG | Morgan Stanley | (683) | 37 | Hornbach Holding AG & Co KGaA | Goldman Sachs | (377) |
| (640) | Evotec SE | Bank of America Merrill Lynch | (143) | 101 | HUGO BOSS AG | Bank of America Merrill Lynch | (179) |
| (823) | Evotec SE | Morgan Stanley | (97) | 363 | HUGO BOSS AG | Goldman Sachs | (643) |
| 232 | flatexDEGIRO AG | Bank of America Merrill Lynch | (264) | 155 | HUGO BOSS AG | Morgan Stanley | (473) |
| 473 | flatexDEGIRO AG | Goldman Sachs | (538) | (16) | Hypoport SE | Bank of America Merrill Lynch | (91) |
| 2.107 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | Goldman Sachs | 2.272 | (29) | Hypoport SE | Goldman Sachs | (164) |
| 1.567 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | Morgan Stanley | (4.384) | (362) | Indus Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | 483 |
| 1.998 | Freenet AG | Bank of America Merrill Lynch | (7.040) | (305) | Indus Holding AG | Goldman Sachs | 407 |
| 2.302 | Freenet AG | Goldman Sachs | (8.111) | (1.073) | Infineon Technologies AG | Bank of America Merrill Lynch | (1.799) |
| 2.470 | Freenet AG | Morgan Stanley | (2.743) | (1.388) | Infineon Technologies AG | Goldman Sachs | (2.327) |
| (2.649) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Goldman Sachs | 10.692 | (1.398) | Infineon Technologies AG | Morgan Stanley | 1.403 |
| (890) | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | Morgan Stanley | 2.632 | (224) | Jenoptik AG | Bank of America Merrill Lynch | (622) |
| 166 | FUCHS PETROLUB SE Pref) | Bank of America Merrill Lynch | (404) | (562) | Jenoptik AG | Goldman Sachs | (1.560) |
| 102 | FUCHS PETROLUB SE Pref) | Goldman Sachs | (248) | (121) | JOST Werke SE | Bank of America Merrill Lynch | 13 |
| 482 | FUCHS PETROLUB SE Pref) | Morgan Stanley | (1.143) | (152) | JOST Werke SE | Goldman Sachs | 16 |
| 100 | GEA Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (136) | (158) | Jungheinrich AG (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 246 |
| 51 | GEA Group AG | Goldman Sachs | (69) | (306) | Jungheinrich AG (Pref) | Goldman Sachs | 477 |
| (64) | Gerresheimer AG | Bank of America Merrill Lynch | (321) | 5.359 | Kloeckner & Co SE | Bank of America Merrill Lynch | (5.368) |
| (35) | Gerresheimer AG | Goldman Sachs | (176) | 438 | Knorr-Bremse AG | Goldman Sachs | (1.066) |
| 45 | GFT Technologies SE | Bank of America Merrill Lynch | (6) | 2.315 | Knorr-Bremse AG | Morgan Stanley | (9.047) |
| 123 | GFT Technologies SE | Goldman Sachs | (16) | 297 | Kontron AG | Bank of America Merrill Lynch | 140 |
| 1.512 | Grand City Properties SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.090) | 606 | Kontron AG | Goldman Sachs | 380 |
| 1.298 | Grand City Properties SA | Goldman Sachs | (935) | 194 | Krones AG | Bank of America Merrill Lynch | (628) |
| (1.619) | Hamborner AG (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 449 | 348 | Krones AG | Goldman Sachs | (836) |
| (862) | Hamborner AG (REIT) | Goldman Sachs | 239 | 213 | LEG Immobilien SE | Bank of America Merrill Lynch | (1.342) |
| (330) | Hamburger Hafen und Logistik AG | Bank of America Merrill Lynch | 70 | 80 | LEG Immobilien SE | Goldman Sachs | (504) |
| (376) | Hamburger Hafen und Logistik AG | Goldman Sachs | 80 | 167 | LEG Immobilien SE | Morgan Stanley | (685) |
| (139) | Hannover Rueck SE | Bank of America Merrill Lynch | (1.677) | (99) | MBB SE | Bank of America Merrill Lynch | 222 |
| (147) | Hannover Rueck SE | Goldman Sachs | (1.774) | (9) | Medios AG | Bank of America Merrill Lynch | (1) |
| (69) | Hannover Rueck SE | Morgan Stanley | (457) | (260) | Medios AG | Goldman Sachs | (39) |
| 3.463 | Heidelberger Druckmaschinen AG | Bank of America Merrill Lynch | (270) | 2.112 | Mercedes-Benz Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 5.097 |
| 3.396 | Heidelberger Druckmaschinen AG | Goldman Sachs | (265) | 363 | Mercedes-Benz Group AG | Goldman Sachs | 876 |
| (218) | Hella GmbH & Co KGaA | Morgan Stanley | 396 | 1.205 | Mercedes-Benz Group AG | Morgan Stanley | (1.467) |
| (256) | HelloFresh SE | Bank of America Merrill Lynch | 197 | 94 | Merck KGaA | Goldman Sachs | (186) |
| (276) | HelloFresh SE | Morgan Stanley | (127) | (29) | Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen Reg | Morgan Stanley | (201) |
| (419) | Henkel AG & Co KGaA Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 1.181 | 376 | Nemetschek SE | Bank of America Merrill Lynch | 1.831 |
| (909) | Henkel AG & Co KGaA Pref) | Goldman Sachs | 2.515 | 223 | Nemetschek SE | Goldman Sachs | 1.099 |
| (944) | Henkel AG & Co KGaA Pref) | Morgan Stanley | 2.963 | 158 | Nemetschek SE | Morgan Stanley | 125 |
| | | | | (620) | Norma Group SE | Bank of America Merrill Lynch | 1.067 |
| | | | | (767) | Norma Group SE | Goldman Sachs | 1.614 |
| | | | | (26) | OHB SE | Goldman Sachs | 28 |
| | | | | 49 | Pfeiffer Vacuum Technology AG | Bank of America Merrill Lynch | 10 |
| | | | | 35 | Pfeiffer Vacuum Technology AG | Goldman Sachs | 7 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------------|--|-------------------------------|---|
| Deutschland Fortsetzung | | | | Deutschland Fortsetzung | | | |
| (658) | PNE AG | Bank of America Merrill Lynch | — | 65 | Volkswagen AG (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | (133) |
| (1.352) | PNE AG | Goldman Sachs | (3) | 28 | Volkswagen AG (Pref) | Goldman Sachs | (75) |
| (291) | PVA TePla AG | Goldman Sachs | (91) | 63 | Volkswagen AG (Pref) | Morgan Stanley | (249) |
| 302 | Salzgitter AG | Bank of America Merrill Lynch | (630) | (656) | Vonovia SE | Bank of America Merrill Lynch | 724 |
| 453 | Salzgitter AG | Goldman Sachs | (1.437) | (406) | Vonovia SE | Goldman Sachs | 367 |
| (179) | SAP SE | Morgan Stanley | 291 | (3.274) | Vonovia SE | Morgan Stanley | 2.193 |
| 46 | Sartorius AG (Pref) | Morgan Stanley | (1.144) | 108 | Wacker Neuson SE | Bank of America Merrill Lynch | (225) |
| 1.902 | Schaeffler AG (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | (860) | 110 | Wacker Neuson SE | Goldman Sachs | (229) |
| 3.710 | Schaeffler AG (Pref) | Goldman Sachs | (1.674) | (375) | Wuestenrot & Wuerttembergische AG | Bank of America Merrill Lynch | 368 |
| (485) | SGL Carbon SE | Goldman Sachs | 256 | (592) | Wuestenrot & Wuerttembergische AG | Goldman Sachs | 582 |
| 58 | Siemens AG Reg | Goldman Sachs | (278) | | | | (11.409) |
| 469 | Siemens AG Reg | Morgan Stanley | (1.583) | Hongkong | | | |
| 169 | Siemens Energy AG | Bank of America Merrill Lynch | 123 | 2.200 | ASMP T Ltd | Goldman Sachs | 1.825 |
| 234 | Siemens Energy AG | Goldman Sachs | 170 | 2.200 | ASMP T Ltd | Morgan Stanley | 463 |
| (392) | Siemens Healthineers AG | Goldman Sachs | 745 | (710) | AustAsia Group Ltd | Goldman Sachs | (236) |
| (754) | Siemens Healthineers AG | Morgan Stanley | 644 | 1.200 | Bank of East Asia Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (81) |
| (264) | Siltronic AG | Bank of America Merrill Lynch | (5.415) | 9.600 | Bank of East Asia Ltd | Goldman Sachs | (650) |
| (423) | Siltronic AG | Goldman Sachs | (6.393) | 7.000 | Bank of East Asia Ltd | Morgan Stanley | (349) |
| (325) | Sixt SE | Bank of America Merrill Lynch | 3.574 | 2.000 | Cafe de Coral Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (409) |
| (199) | Sixt SE | Goldman Sachs | 2.189 | 19.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (606) |
| (422) | Sixt SE | Morgan Stanley | 6.038 | 38.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | Goldman Sachs | (1.213) |
| (24) | Sixt SE (Pref) | Bank of America Merrill Lynch | 261 | 67.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | Morgan Stanley | (3.678) |
| (49) | Sixt SE (Pref) | Goldman Sachs | 534 | (2.000) | Chow Sang Sang Holdings International Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 327 |
| (32) | Software AG | Bank of America Merrill Lynch | 28 | (2.000) | Chow Sang Sang Holdings International Ltd | Goldman Sachs | 327 |
| (739) | Software AG | Goldman Sachs | 427 | (10.500) | CK Hutchison Holdings Ltd | Goldman Sachs | 6.702 |
| 118 | Stabilus SE | Bank of America Merrill Lynch | (354) | (9.500) | CLP Holdings Ltd | Goldman Sachs | 4.729 |
| 51 | Stabilus SE | Goldman Sachs | (149) | 68.400 | Dah Sing Banking Group Ltd | Goldman Sachs | (4.540) |
| 44 | Steico SE | Bank of America Merrill Lynch | (40) | 4.800 | Dah Sing Financial Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (919) |
| 69 | Steico SE | Goldman Sachs | (63) | 12.800 | Dah Sing Financial Holdings Ltd | Goldman Sachs | (2.451) |
| (2) | STO SE & Co KGaA (Pref) | Goldman Sachs | 29 | (3.000) | EC Healthcare | Goldman Sachs | 226 |
| (619) | Stroer SE & Co KGaA | Bank of America Merrill Lynch | 1.058 | (8.000) | E-Commodities Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 163 |
| (627) | Stroer SE & Co KGaA | Goldman Sachs | 1.071 | (26.000) | E-Commodities Holdings Ltd | Goldman Sachs | 531 |
| 1.091 | Suedzucker AG | Bank of America Merrill Lynch | (2.877) | 2.000 | First Pacific Co Ltd | Goldman Sachs | (13) |
| 244 | Suedzucker AG | Goldman Sachs | (556) | 22.000 | First Pacific Co Ltd | Morgan Stanley | (197) |
| (1.616) | Synlab AG | Goldman Sachs | 1.065 | (600) | Fosun Tourism Group | Bank of America Merrill Lynch | 113 |
| 296 | TAG Immobilien AG | Bank of America Merrill Lynch | (212) | (9.000) | Fosun Tourism Group | Goldman Sachs | 1.689 |
| 3.317 | TAG Immobilien AG | Goldman Sachs | (2.380) | 1.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (434) |
| (483) | Takkt AG | Goldman Sachs | 536 | 2.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd | Morgan Stanley | (906) |
| 937 | Talanx AG | Bank of America Merrill Lynch | 3.452 | (3.000) | Guotai Junan International Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 31 |
| 970 | Talanx AG | Goldman Sachs | 3.573 | 11.000 | Haitong International Securities Group Ltd | Morgan Stanley | — |
| 740 | Talanx AG | Morgan Stanley | 1.983 | 3.300 | Haitong International Securities Group Ltd (Right) | Morgan Stanley | 4 |
| (5.720) | Telefonica Deutschland Holding AG | Morgan Stanley | 794 | 5.000 | Hang Lung Properties Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (434) |
| 515 | thyssenkrupp AG | Bank of America Merrill Lynch | 52 | 2.000 | Hang Lung Properties Ltd | Goldman Sachs | (174) |
| 6.638 | thyssenkrupp AG | Goldman Sachs | 557 | 7.000 | Hang Lung Properties Ltd | Morgan Stanley | (304) |
| 2.404 | United Internet AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (2.670) | (2.600) | Hang Seng Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.987 |
| 800 | United Internet AG Reg | Goldman Sachs | (888) | (900) | Hang Seng Bank Ltd | Goldman Sachs | 1.034 |
| 735 | United Internet AG Reg | Morgan Stanley | (620) | | | | |
| (56) | VERBIO Vereinigte BioEnergie AG | Bank of America Merrill Lynch | 10 | | | | |
| 217 | Vitesco Technologies Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (29) | | | | |
| 442 | Vitesco Technologies Group AG | Goldman Sachs | (132) | | | | |
| 204 | Volkswagen AG | Morgan Stanley | (1.808) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---|-------------------------------|---|-----------------------------|--|-------------------------------|---|
| Hongkong Fortsetzung | | | | Hongkong Fortsetzung | | | |
| 15.500 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | Goldman Sachs | (2.770) | (1.000) | Texhong International Group Ltd | Goldman Sachs | 40 |
| 500 | HKBN Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (43) | (30.000) | Theme International Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 383 |
| (2.000) | HKT Trust & HKT Ltd (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 51 | (10.000) | Theme International Holdings Ltd | Goldman Sachs | 128 |
| (104.000) | HKT Trust & HKT Ltd (Unit) | Goldman Sachs | 2.655 | 150.000 | United Energy Group Ltd | Goldman Sachs | (3.447) |
| (16.000) | Hong Kong & China Gas Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 817 | 164.000 | United Energy Group Ltd | Morgan Stanley | (2.512) |
| (35.000) | Hong Kong & China Gas Co Ltd | Goldman Sachs | 1.787 | 2.000 | United Laboratories International Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (13) |
| 3.000 | Hysan Development Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (934) | (4.000) | Vesync Co Ltd | Goldman Sachs | (20) |
| 3.000 | Hysan Development Co Ltd | Goldman Sachs | (934) | (8.000) | Viva Goods Company Ltd | Goldman Sachs | 122 |
| 6.000 | Hysan Development Co Ltd | Morgan Stanley | (1.103) | (25.000) | Vobile Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.372 |
| 19.000 | IGG Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.746) | (15.000) | Vobile Group Ltd | Goldman Sachs | 823 |
| 51.000 | IGG Inc | Goldman Sachs | (4.687) | (3.300) | VTech Holdings Ltd | Goldman Sachs | (758) |
| (11.000) | JS Global Lifestyle Co Ltd | Goldman Sachs | 42 | 16.000 | Wharf Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.614) |
| (13.000) | Kerry Logistics Network Ltd | Goldman Sachs | 2.921 | 1.000 | Wharf Holdings Ltd | Goldman Sachs | (163) |
| 600 | Link (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (383) | 7.000 | Wharf Holdings Ltd | Morgan Stanley | (661) |
| 5.000 | Link (REIT) | Goldman Sachs | (3.191) | (1.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 549 |
| 5.500 | L'Occitane International SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.790) | (3.000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Morgan Stanley | 651 |
| 2.000 | L'Occitane International SA | Goldman Sachs | (651) | 6.000 | Wynn Macau Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (467) |
| 4.000 | Luk Fook Holdings International Ltd | Goldman Sachs | (1.557) | 12.000 | Wynn Macau Ltd | Goldman Sachs | (934) |
| (28.000) | Man Wah Holdings Ltd | Goldman Sachs | 3.145 | 18.400 | Wynn Macau Ltd | Morgan Stanley | (822) |
| (200) | MECOM Power and Construction Ltd | Goldman Sachs | 1 | (52.000) | Xinyi Glass Holdings Ltd | Goldman Sachs | 11.550 |
| 28.400 | MGM China Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.719) | 10.500 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.171) |
| 6.000 | MGM China Holdings Ltd | Goldman Sachs | (574) | 27.000 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | Goldman Sachs | (5.583) |
| 9.600 | MGM China Holdings Ltd | Morgan Stanley | (552) | 36.500 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | Morgan Stanley | (5.871) |
| (12.002) | MTR Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.903 | | | | (26.748) |
| 30.000 | New World Development Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (5.744) | Irland | | | |
| 25.000 | New World Development Co Ltd | Goldman Sachs | (4.787) | (4.011) | Bank of Ireland Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.465 |
| 8.000 | New World Development Co Ltd | Morgan Stanley | (776) | (6.433) | Cairn Homes Plc | Bank of America Merrill Lynch | 261 |
| 7.000 | Nissin Foods Co Ltd | Goldman Sachs | (80) | (9.188) | Cairn Homes Plc | Goldman Sachs | 373 |
| (4.000) | Pacific Textiles Holdings Ltd | Goldman Sachs | 117 | 2.893 | Dalata Hotel Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 54 |
| 3.000 | PAX Global Technology Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (172) | 3.984 | Dalata Hotel Group Plc | Goldman Sachs | 51 |
| (253.000) | PCCW Ltd | Goldman Sachs | 3.875 | (5.540) | Irish Residential Properties Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 111 |
| (4.500) | Power Assets Holdings Ltd | Goldman Sachs | 2.527 | (9.076) | Irish Residential Properties Plc (REIT) | Goldman Sachs | 161 |
| 3.000 | PRADA SpA | Bank of America Merrill Lynch | (2.872) | 192 | Origin Enterprises Plc | Bank of America Merrill Lynch | (43) |
| 7.500 | PRADA SpA | Goldman Sachs | (7.180) | | | | 2.433 |
| 3.000 | PRADA SpA | Morgan Stanley | (2.566) | Israel | | | |
| (33.000) | Prosperity (REIT) | Goldman Sachs | 842 | 183 | Airport City Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (223) |
| (46.097) | Sino Land Co Ltd | Goldman Sachs | 2.236 | 493 | Airport City Ltd | Morgan Stanley | (449) |
| (3.000) | Sun Hung Kai & Co Ltd | Goldman Sachs | 57 | 1.687 | Alony Hetz Properties & Investments Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (453) |
| (2.000) | SUNeVision Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 43 | 2.802 | Alony Hetz Properties & Investments Ltd | Goldman Sachs | (753) |
| (14.000) | SUNeVision Holdings Ltd | Goldman Sachs | 304 | 471 | Alony Hetz Properties & Investments Ltd | Morgan Stanley | (111) |
| 3.000 | Swire Pacific Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.164) | (216) | Ashtrom Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 600 |
| 11.500 | Swire Pacific Ltd 'A' | Morgan Stanley | (6.092) | (2.832) | Ashtrom Group Ltd | Morgan Stanley | 8.338 |
| 1.200 | Swire Properties Ltd | Goldman Sachs | (328) | (549) | Azrieli Group Ltd | Goldman Sachs | 2.728 |
| 28.000 | Swire Properties Ltd | Morgan Stanley | (5.326) | (7.962) | Bank Hapoalim BM | Goldman Sachs | 4.791 |
| (9.500) | Techtronic Industries Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 12.248 | (18.285) | Bank Leumi Le-Israel BM | Goldman Sachs | 13.017 |
| (2.500) | Techtronic Industries Co Ltd | Goldman Sachs | 3.223 | | | | |
| (1.000) | Texhong International Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 40 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---------------------------|--|----------------------------------|---|----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---|
| Israel Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| (172) | Big Shopping Centers Ltd | Morgan Stanley | 638 | (1.072) | BFF Bank SpA | Goldman Sachs | (1.185) |
| (155) | Delek Automotive Systems Ltd | Goldman Sachs | 152 | 192 | Biesse SpA | Bank of America Merrill Lynch | (168) |
| (1.159) | Doral Group Renewable Energy Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 374 | 287 | Biesse SpA | Goldman Sachs | (251) |
| (25) | Electra Consumer Products 1970 Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 73 | 10.160 | BPER Banca | Morgan Stanley | (2.235) |
| (64) | First International Bank Of Israel Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (15) | 203 | Brembo SpA | Bank of America Merrill Lynch | (24) |
| 1.843 | Gav-Yam Lands Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (713) | 153 | Brembo SpA | Goldman Sachs | (18) |
| 312 | Gav-Yam Lands Corp Ltd | Goldman Sachs | (121) | 99 | Brunello Cucinelli SpA | Bank of America Merrill Lynch | (317) |
| 734 | Gav-Yam Lands Corp Ltd | Morgan Stanley | (73) | 649 | Brunello Cucinelli SpA | Goldman Sachs | (2.079) |
| (3.788) | ICL Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.578 | 445 | Buzzi SpA | Goldman Sachs | (532) |
| (2.536) | Isracard Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 61 | 717 | Buzzi SpA | Morgan Stanley | (919) |
| (1.956) | Israel Discount Bank Ltd 'A' | Goldman Sachs | 478 | 2.245 | CIR SpA-Compagnie Industriali | Bank of America Merrill Lynch | (6) |
| (931) | Kenon Holdings Ltd | Morgan Stanley | 2.148 | (2.655) | CNH Industrial NV | Bank of America Merrill Lynch | 2.395 |
| (393) | Maytronics Ltd | Goldman Sachs | (435) | 808 | Credito Emiliano SpA | Bank of America Merrill Lynch | (292) |
| 2.961 | Mivne Real Estate KD Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.040) | 483 | Credito Emiliano SpA | Goldman Sachs | (163) |
| 893 | Mivne Real Estate KD Ltd | Goldman Sachs | (314) | 161 | Danieli & C Officine Meccaniche SpA | Bank of America Merrill Lynch | (146) |
| 1.918 | Mivne Real Estate KD Ltd | Morgan Stanley | (349) | 268 | Danieli & C Officine Meccaniche SpA | Goldman Sachs | (243) |
| (1.613) | Naphtha Israel Petroleum Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 9 | 463 | Datalogic SpA | Bank of America Merrill Lynch | (227) |
| (195) | Nova Ltd | Goldman Sachs | (3.243) | 517 | Datalogic SpA | Goldman Sachs | (254) |
| (43) | Paz Oil Co Ltd | Goldman Sachs | (152) | (115) | DiaSorin SpA | Goldman Sachs | 900 |
| (14) | Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd | Goldman Sachs | (33) | (261) | DiaSorin SpA | Morgan Stanley | 1.430 |
| (9.261) | Shufersal Ltd | Goldman Sachs | (1.518) | (1.299) | Digital Bros SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.914 |
| (1.381) | Strauss Group Ltd | Goldman Sachs | (1.758) | (511) | Digital Bros SpA | Goldman Sachs | 753 |
| 73 | YH Dimri Construction & Development Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (325) | (1.623) | Enav SpA | Bank of America Merrill Lynch | 191 |
| 69 | YH Dimri Construction & Development Ltd | Goldman Sachs | (308) | (581) | Enav SpA | Goldman Sachs | 68 |
| | | | 23.599 | 867 | Enel SpA | Bank of America Merrill Lynch | (124) |
| | | | | 300 | Enel SpA | Goldman Sachs | (43) |
| | | | | 12.394 | Enel SpA | Morgan Stanley | (2.051) |
| | | | | (3.186) | Eni SpA | Bank of America Merrill Lynch | 2.715 |
| 1.455 | A2A SpA | Bank of America Merrill Lynch | (250) | (3.192) | Eni SpA | Goldman Sachs | 2.720 |
| 60.601 | A2A SpA | Goldman Sachs | (10.418) | (7.174) | Eni SpA | Morgan Stanley | 5.530 |
| 76.519 | A2A SpA | Morgan Stanley | (1.675) | 1.300 | ERG SpA | Goldman Sachs | (2.887) |
| (370) | ACEA SpA | Bank of America Merrill Lynch | 55 | (301) | Esprinet SpA | Bank of America Merrill Lynch | 567 |
| (409) | ACEA SpA | Goldman Sachs | 61 | (455) | Esprinet SpA | Goldman Sachs | 857 |
| (309) | Antares Vision SpA | Goldman Sachs | 20 | 65 | Ferrari NV | Bank of America Merrill Lynch | (111) |
| (61) | Ariston Holding NV | Bank of America Merrill Lynch | (9) | 130 | Ferrari NV | Goldman Sachs | (222) |
| (53) | Ariston Holding NV | Goldman Sachs | (8) | 10 | Ferrari NV | Morgan Stanley | (108) |
| (971) | Assicurazioni Generali SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.177 | (313) | Fila SpA | Goldman Sachs | (110) |
| (2.300) | Assicurazioni Generali SpA | Goldman Sachs | 2.787 | 510 | FinecoBank Banca Fineco SpA | Bank of America Merrill Lynch | (5) |
| (5.943) | Assicurazioni Generali SpA | Morgan Stanley | 1.999 | 304 | FinecoBank Banca Fineco SpA | Goldman Sachs | (3) |
| (100) | Azimet Holding SpA | Goldman Sachs | 169 | 257 | FinecoBank Banca Fineco SpA | Morgan Stanley | 63 |
| 161 | Banca IFIS SpA | Bank of America Merrill Lynch | (50) | (324) | Gruppo MutuiOnline SpA | Bank of America Merrill Lynch | (450) |
| 198 | Banca IFIS SpA | Goldman Sachs | (61) | (222) | Gruppo MutuiOnline SpA | Goldman Sachs | (308) |
| (248) | Banca Mediolanum SpA | Bank of America Merrill Lynch | (9) | (3.035) | GVS SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.329) |
| 4.543 | Banca Popolare di Sondrio SPA | Bank of America Merrill Lynch | (3.376) | (944) | GVS SpA | Goldman Sachs | (413) |
| 5.487 | Banca Popolare di Sondrio SPA | Goldman Sachs | (3.965) | 2.055 | Hera SpA | Goldman Sachs | (237) |
| 3.208 | Banco BPM SpA | Bank of America Merrill Lynch | (805) | 2.026 | Hera SpA | Morgan Stanley | (126) |
| 1.102 | Banco BPM SpA | Morgan Stanley | (340) | (1.142) | Illimity Bank SpA | Bank of America Merrill Lynch | 229 |
| (688) | BFF Bank SpA | Bank of America Merrill Lynch | (760) | (264) | Illimity Bank SpA | Goldman Sachs | 61 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|---|-------------------------------|---|----------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Italien Fortsetzung | | | | Italien Fortsetzung | | | |
| (605) | Industrie De Nora SpA | Bank of America Merrill Lynch | (646) | 236 | RAI Way SpA | Bank of America Merrill Lynch | (73) |
| (644) | Industrie De Nora SpA | Goldman Sachs | (517) | 106 | RAI Way SpA | Goldman Sachs | (33) |
| 1.643 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Bank of America Merrill Lynch | (263) | 245 | Reply SpA | Bank of America Merrill Lynch | (471) |
| 215 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA | Morgan Stanley | (9) | 372 | Reply SpA | Goldman Sachs | (715) |
| (1.243) | Interpump Group SpA | Bank of America Merrill Lynch | (345) | (2.545) | Saipem SpA | Goldman Sachs | 221 |
| (142) | Interpump Group SpA | Goldman Sachs | (39) | (31) | Salvatore Ferragamo SpA | Bank of America Merrill Lynch | 14 |
| (680) | Interpump Group SpA | Morgan Stanley | 2.265 | (104) | Salvatore Ferragamo SpA | Goldman Sachs | 8 |
| 18.138 | Intesa Sanpaolo SpA | Bank of America Merrill Lynch | (4.842) | 76 | Sanlorenzo SpA | Bank of America Merrill Lynch | (162) |
| 7.168 | Intesa Sanpaolo SpA | Goldman Sachs | (1.913) | 187 | Sanlorenzo SpA | Goldman Sachs | (399) |
| 6.293 | Intesa Sanpaolo SpA | Morgan Stanley | (1.146) | (6.973) | Saras SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.254 |
| 6.222 | Iren SpA | Bank of America Merrill Lynch | (478) | (13.980) | Saras SpA | Goldman Sachs | 2.515 |
| 6.871 | Iren SpA | Goldman Sachs | (528) | 79 | Sesa SpA | Bank of America Merrill Lynch | (51) |
| 584 | Italgas SpA | Bank of America Merrill Lynch | (365) | 315 | Sesa SpA | Goldman Sachs | (202) |
| 384 | Italgas SpA | Goldman Sachs | (240) | 2.986 | Snam SpA | Goldman Sachs | (673) |
| (1.176) | Iveco Group NV | Goldman Sachs | 412 | 873 | Snam SpA | Morgan Stanley | (158) |
| (275) | Iveco Group NV | Morgan Stanley | 160 | 88 | SOL SpA | Bank of America Merrill Lynch | (61) |
| (6.126) | Leonardo SpA | Bank of America Merrill Lynch | 6.247 | 153 | SOL SpA | Goldman Sachs | (106) |
| (337) | Leonardo SpA | Goldman Sachs | 344 | (14.295) | Stellantis NV | Bank of America Merrill Lynch | 8.364 |
| (669) | Leonardo SpA | Morgan Stanley | 786 | (1.181) | Stellantis NV | Goldman Sachs | 691 |
| 4.318 | Maire Tecnimont SpA | Goldman Sachs | (9) | (3.643) | Stellantis NV | Morgan Stanley | 3.921 |
| (345) | MARR SpA | Bank of America Merrill Lynch | 354 | (49) | Tamburi Investment Partners SpA | Goldman Sachs | (2) |
| (275) | MARR SpA | Goldman Sachs | 282 | (827) | Technogym SpA | Bank of America Merrill Lynch | 124 |
| 1.888 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.066 | (1.483) | Technogym SpA | Goldman Sachs | 222 |
| 1.917 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Goldman Sachs | 1.083 | (1.121) | Technoprobe SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.173) |
| 3.994 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | Morgan Stanley | 320 | (2.408) | Technoprobe SpA | Goldman Sachs | (2.452) |
| (2.032) | MFE-MediaForEurope NV 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 20 | (2.359) | Tenaris SA | Morgan Stanley | 970 |
| (13.749) | MFE-MediaForEurope NV 'A' | Goldman Sachs | 135 | 143 | Tinexta Spa | Goldman Sachs | (134) |
| 3.422 | MFE-MediaForEurope NV 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (101) | 24 | Tod's SpA | Bank of America Merrill Lynch | (18) |
| 8.141 | MFE-MediaForEurope NV 'B' | Goldman Sachs | (239) | 140 | Tod's SpA | Goldman Sachs | (105) |
| 898 | Moncler SpA | Bank of America Merrill Lynch | (2.167) | 3.874 | Unipol Gruppo SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.874) |
| 1.032 | Moncler SpA | Goldman Sachs | (2.490) | 4.181 | Unipol Gruppo SpA | Goldman Sachs | (2.022) |
| 1.489 | Moncler SpA | Morgan Stanley | (2.162) | 4.788 | UnipolSai Assicurazioni SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.196) |
| (2.531) | Nexi SpA | Bank of America Merrill Lynch | 1.049 | 8.117 | UnipolSai Assicurazioni SpA | Goldman Sachs | (2.028) |
| (3.795) | Nexi SpA | Goldman Sachs | 1.572 | 7.349 | UnipolSai Assicurazioni SpA | Morgan Stanley | (534) |
| (4.080) | Nexi SpA | Morgan Stanley | 2.056 | 6.736 | Webuild SpA | Bank of America Merrill Lynch | (1.129) |
| 1.201 | OVS SpA | Bank of America Merrill Lynch | (336) | 8.338 | Webuild SpA | Goldman Sachs | (1.398) |
| 4.278 | OVS SpA | Goldman Sachs | (1.197) | 115 | Wiit SpA | Bank of America Merrill Lynch | 71 |
| 13 | Pharmanutra SpA | Bank of America Merrill Lynch | 21 | 311 | Wiit SpA | Goldman Sachs | 193 |
| 75 | Pharmanutra SpA | Goldman Sachs | 120 | Japan | | | |
| 1.813 | Piaggio & C SpA | Bank of America Merrill Lynch | 54 | 700 | 77 Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 431 |
| 1.888 | Piaggio & C SpA | Goldman Sachs | 56 | 800 | 77 Bank Ltd | Goldman Sachs | 565 |
| (394) | Pirelli & C SpA | Goldman Sachs | 181 | 13.200 | Acom Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.224) |
| (507) | Pirelli & C SpA | Morgan Stanley | 268 | 31.800 | Acom Co Ltd | Goldman Sachs | (2.949) |
| (448) | Poste Italiane SpA | Bank of America Merrill Lynch | (34) | (3) | Activia Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 225 |
| (530) | Poste Italiane SpA | Goldman Sachs | (41) | (3) | Activia Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 225 |
| (856) | Poste Italiane SpA | Morgan Stanley | 154 | (1) | Activia Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 82 |
| (56) | Prysmian SpA | Bank of America Merrill Lynch | 47 | 1.000 | Adastria Co Ltd | Goldman Sachs | 721 |
| | | | | (600) | ADEKA Corp | Bank of America Merrill Lynch | (300) |
| | | | | | | | (12.307) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--|----------------------------------|---|--------------------------|----------------------------|----------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.500) | ADEKA Corp | Goldman Sachs | (749) | (700) | Appier Group Inc | Bank of America | |
| (13) | Advance Logistics Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 158 | (1.500) | Appier Group Inc | Merrill Lynch | 919 |
| (12) | Advance Logistics Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 146 | 400 | Arata Corp | Goldman Sachs | 1.969 |
| (5) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (143) | 100 | Arata Corp | Bank of America Merrill Lynch | 57 |
| (25) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (713) | (1.200) | ARCLANDS Corp | Goldman Sachs | 14 |
| (10) | Advance Residence Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (464) | (5.600) | ARCLANDS Corp | Bank of America Merrill Lynch | 531 |
| 700 | Aeon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (215) | (500) | Arcs Co Ltd | Goldman Sachs | 2.477 |
| 200 | Aeon Co Ltd | Goldman Sachs | (61) | (400) | ARCLANDS Corp | Bank of America Merrill Lynch | 713 |
| 700 | Aeon Co Ltd | Morgan Stanley | (682) | (400) | ARCLANDS Corp | Goldman Sachs | 713 |
| 900 | Aeon Delight Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (674) | (400) | ARTERIA Networks Corp | Bank of America Merrill Lynch | (11) |
| 1.600 | Aeon Delight Co Ltd | Goldman Sachs | (1.199) | (100) | ARTERIA Networks Corp | Goldman Sachs | (11) |
| 5.200 | AEON Financial Service Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.298) | (1.100) | As One Corp | Morgan Stanley | 257 |
| 1.600 | AEON Financial Service Co Ltd | Goldman Sachs | (400) | (1.100) | Asahi Group Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 989 |
| 3.200 | AEON Financial Service Co Ltd | Morgan Stanley | (936) | (900) | Asahi Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | 809 |
| (5.100) | Aeon Hokkaido Corp | Bank of America Merrill Lynch | 437 | (1.300) | Asahi Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | 1.521 |
| (300) | Aeon Hokkaido Corp | Goldman Sachs | 26 | (1.600) | Asahi Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.438 |
| (3) | AEON Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (54) | (4.400) | Asahi Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.955 |
| (3) | AEON Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (66) | (1.600) | Asics Corp | Morgan Stanley | 1.313 |
| (500) | Aeon Mall Co Ltd | Goldman Sachs | 353 | (200) | ASKUL Corp | Bank of America Merrill Lynch | (7) |
| (300) | AGC Inc | Goldman Sachs | (171) | 5.800 | Astellas Pharma Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.303 |
| (100) | AGC Inc | Morgan Stanley | (36) | 3.800 | Astellas Pharma Inc | Goldman Sachs | 782 |
| 2.000 | Aichi Corp | Bank of America Merrill Lynch | (293) | 1.800 | Astellas Pharma Inc | Morgan Stanley | (1.303) |
| 2.000 | Aichi Corp | Goldman Sachs | (298) | (3.300) | Atom Corp | Bank of America Merrill Lynch | 612 |
| (700) | Aichi Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 290 | (8.800) | Atom Corp | Goldman Sachs | 1.548 |
| (1.200) | Aichi Financial Group Inc | Goldman Sachs | 574 | (300) | Autobacs Seven Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 186 |
| (700) | Aida Engineering Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 100 | (3.100) | Autobacs Seven Co Ltd | Goldman Sachs | 1.924 |
| (900) | Aida Engineering Ltd | Goldman Sachs | 128 | 500 | Avex Inc | Bank of America Merrill Lynch | (239) |
| (7.400) | Aiful Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.319 | 1.000 | Avex Inc | Goldman Sachs | (401) |
| (9.800) | Aiful Corp | Goldman Sachs | 2.100 | (1.900) | Awa Bank Ltd | Goldman Sachs | 1.234 |
| (800) | Airtrip Corp | Bank of America Merrill Lynch | 439 | (100) | Axial Retailing Inc | Bank of America Merrill Lynch | 39 |
| 800 | Aisin Corp | Bank of America Merrill Lynch | 428 | 1.400 | AZ-COM MARUWA Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (529) |
| 400 | Aisin Corp | Goldman Sachs | 214 | 1.100 | AZ-COM MARUWA Holdings Inc | Goldman Sachs | (416) |
| 100 | Aisin Corp | Morgan Stanley | 7 | 1.800 | AZ-COM MARUWA Holdings Inc | Morgan Stanley | (950) |
| 2.500 | Alfresa Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 339 | (500) | Bandai Namco Holdings Inc | Goldman Sachs | (36) |
| 800 | Alfresa Holdings Corp | Goldman Sachs | 108 | (1.800) | Bandai Namco Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.657 |
| 4.100 | Alfresa Holdings Corp | Morgan Stanley | (3.452) | (100) | Bank of Kyoto Ltd | Goldman Sachs | 207 |
| 600 | Alpen Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (308) | (900) | Bank of Kyoto Ltd | Morgan Stanley | 1.220 |
| 800 | Alpen Co Ltd | Goldman Sachs | (411) | 200 | Belc Co Ltd | Goldman Sachs | (571) |
| (300) | Alpha Systems Inc | Goldman Sachs | 749 | 1.500 | Bell System24 Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| 200 | Anicom Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 77 | 1.400 | Bell System24 Holdings Inc | Goldman Sachs | (120) |
| 3.300 | Anicom Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.271 | 600 | Belluna Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (355) |
| 2.300 | Anritsu Corp | Bank of America Merrill Lynch | (558) | 800 | Belluna Co Ltd | Goldman Sachs | (474) |
| 2.500 | Anritsu Corp | Goldman Sachs | (606) | (1.700) | Benefit One Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.232 |
| 1.400 | Anritsu Corp | Morgan Stanley | (170) | (1.700) | Benefit One Inc | Goldman Sachs | 2.232 |
| 2.100 | AOKI Holdings Inc | Goldman Sachs | (764) | (1.000) | Benefit One Inc | Morgan Stanley | 556 |
| | | | | 6.400 | Benesse Holdings Inc | Goldman Sachs | (7.808) |
| | | | | 8.800 | Benesse Holdings Inc | Morgan Stanley | (10.861) |
| | | | | (100) | BIPROGY Inc | Goldman Sachs | 157 |
| | | | | (800) | BML Inc | Goldman Sachs | 400 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------------|-----------------|---|--------------------------|---------------------------------------|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 900 | Brother Industries Ltd | Bank of America | | 1.600 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | Goldman Sachs | (46) |
| | | Merrill Lynch | (148) | | | | |
| 4.500 | Brother Industries Ltd | Goldman Sachs | (738) | 5.200 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.820) |
| 2.200 | Brother Industries Ltd | Morgan Stanley | (1.570) | (700) | COLOPL Inc | Bank of America | |
| 2.300 | Bunka Shutter Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 20 |
| | | Merrill Lynch | (968) | | | Goldman Sachs | 49 |
| 4.100 | Bunka Shutter Co Ltd | Goldman Sachs | (1.740) | (1.700) | COLOPL Inc | Bank of America | |
| (500) | Calbee Inc | Bank of America | | (1.100) | Colowide Co Ltd | Merrill Lynch | 1.256 |
| | | Merrill Lynch | 492 | | | Goldman Sachs | 2.625 |
| (600) | Calbee Inc | Goldman Sachs | 591 | (2.300) | Colowide Co Ltd | Bank of America | |
| 200 | Canon Electronics Inc | Bank of America | | (7) | Comforia Residential Inc (REIT) | Merrill Lynch | 200 |
| | | Merrill Lynch | (77) | | | Goldman Sachs | 200 |
| 200 | Canon Electronics Inc | Goldman Sachs | (41) | (7) | Comforia Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | (910) |
| 100 | Canon Marketing Japan Inc | Morgan Stanley | (29) | | | Morgan Stanley | (9.118) |
| (100) | Capcom Co Ltd | Bank of America | | 1.500 | COMSYS Holdings Corp | Goldman Sachs | (614) |
| | | Merrill Lynch | (150) | 9.000 | COMSYS Holdings Corp | Bank of America | |
| (300) | Capcom Co Ltd | Morgan Stanley | 385 | 500 | Comture Corp | Merrill Lynch | 388 |
| 900 | Casio Computer Co Ltd | Bank of America | | 3.400 | Concordia Financial Group Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (437) | | | Merrill Lynch | 71 |
| 2.000 | Casio Computer Co Ltd | Goldman Sachs | (970) | 3.300 | Concordia Financial Group Ltd | Morgan Stanley | 125 |
| 1.900 | Casio Computer Co Ltd | Morgan Stanley | (718) | (100) | Cosmo Energy Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | |
| 100 | Cawachi Ltd | Bank of America | | | | Goldman Sachs | (1.655) |
| | | Merrill Lynch | (55) | 200 | Cosmos Pharmaceutical Corp | Bank of America | (189) |
| (400) | CellSource Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (51) |
| | | Merrill Lynch | 679 | (22) | CRE Logistics Inc (REIT) | Goldman Sachs | 385 |
| (100) | CellSource Co Ltd | Goldman Sachs | 170 | (9) | CRE Logistics Inc (REIT) | Bank of America | |
| 800 | Central Glass Co Ltd | Bank of America | | | | Goldman Sachs | 342 |
| | | Merrill Lynch | 434 | 300 | Create SD Holdings Co Ltd | Bank of America | (161) |
| 1.500 | Central Glass Co Ltd | Goldman Sachs | 813 | 2.400 | Create SD Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (1.309) |
| (1.900) | Change Holdings Inc | Bank of America | | (3.300) | Credit Saison Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 4.636 | | | Merrill Lynch | 612 |
| (2.200) | Change Holdings Inc | Goldman Sachs | 5.326 | (2.400) | Credit Saison Co Ltd | Goldman Sachs | 445 |
| (1.800) | Chiba Bank Ltd | Bank of America | | (4.400) | Credit Saison Co Ltd | Morgan Stanley | 408 |
| | | Merrill Lynch | 398 | 13.800 | CyberAgent Inc | Bank of America | |
| (1.300) | Chiba Bank Ltd | Goldman Sachs | 288 | | | Merrill Lynch | (16.934) |
| (4.900) | Chiba Bank Ltd | Morgan Stanley | 385 | 7.200 | CyberAgent Inc | Morgan Stanley | (6.010) |
| (4.200) | Chiyoda Corp | Bank of America | | 100 | Cybozu Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 539 | | | Merrill Lynch | (117) |
| (1.000) | Chiyoda Corp | Goldman Sachs | 128 | 400 | Cybozu Inc | Goldman Sachs | (468) |
| (100) | Chofu Seisakusho Co Ltd | Bank of America | | (3.700) | Dai Nippon Printing Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 59 | | | Merrill Lynch | (1.584) |
| (2.000) | Chubu Electric Power Co Inc | Bank of America | | (700) | Dai Nippon Printing Co Ltd | Goldman Sachs | (300) |
| | | Merrill Lynch | (100) | (1.200) | Dai Nippon Printing Co Ltd | Morgan Stanley | 856 |
| (2.500) | Chubu Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | (125) | 2.400 | Daicel Corp | Bank of America | |
| (1.000) | Chubu Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | (207) | | | Merrill Lynch | 822 |
| (500) | Chudenko Corp | Bank of America | | 2.400 | Daicel Corp | Goldman Sachs | 822 |
| | | Merrill Lynch | 335 | 1.000 | Daicel Corp | Morgan Stanley | 93 |
| (800) | Chudenko Corp | Goldman Sachs | 537 | (1.000) | Daido Steel Co Ltd | Bank of America | |
| (1.300) | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 499 |
| | | Merrill Lynch | (1.317) | (400) | Daido Steel Co Ltd | Goldman Sachs | 200 |
| (2.100) | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | (2.127) | (100) | Daido Steel Co Ltd | Morgan Stanley | 178 |
| (1.400) | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | (539) | 300 | Daifuku Co Ltd | Bank of America | |
| 200 | Chugoku Marine Paints Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 711 |
| | | Merrill Lynch | (101) | 300 | Daifuku Co Ltd | Morgan Stanley | 17 |
| 300 | Chugoku Marine Paints Ltd | Goldman Sachs | (152) | 200 | Daihen Corp | Bank of America | |
| (700) | CI Takiron Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 307 |
| | | Merrill Lynch | 45 | 200 | Daiho Corp | Bank of America | |
| (1.100) | CI Takiron Corp | Goldman Sachs | 71 | | | Merrill Lynch | 307 |
| 6.100 | Citizen Watch Co Ltd | Bank of America | | 200 | Daiho Corp | Goldman Sachs | |
| | | Merrill Lynch | 2.568 | (100) | Daiho Corp | Bank of America | |
| 3.200 | Citizen Watch Co Ltd | Goldman Sachs | 1.347 | (200) | Daiho Corp | Merrill Lynch | 78 |
| (500) | CKD Corp | Bank of America | | 600 | Dai-ichi Life Holdings Inc | Goldman Sachs | 157 |
| | | Merrill Lynch | (136) | | | Bank of America | |
| (1.100) | CKD Corp | Goldman Sachs | 138 | 1.300 | Dai-ichi Life Holdings Inc | Merrill Lynch | (1.000) |
| 1.200 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | Bank of America | | 900 | Dai-ichi Life Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.166) |
| | | Merrill Lynch | (34) | | | Morgan Stanley | (873) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------------------------|---|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 100 | Daiichi Sankyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (97) | 2.300 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (1.936) |
| 100 | Daiichi Sankyo Co Ltd | Goldman Sachs | (7) | 1.600 | Dowa Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.482) |
| 1.600 | Daiken Corp | Goldman Sachs | (1.027) | 300 | Dowa Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (653) |
| (300) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 173 | 1.200 | Dowa Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (2.825) |
| (2.100) | Daiki Aluminium Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 1.214 | (500) | Duskin Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.302 |
| (300) | Daikokutenbussan Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 931 | (900) | Duskin Co Ltd | Goldman Sachs | 2.344 |
| 300 | Daiseki Co Ltd | Goldman Sachs | (1.059) | 100 | Earth Corp | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| (400) | Daishi Hokuetsu Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 203 | 200 | Earth Corp | Goldman Sachs | (257) |
| (1.500) | Daishi Hokuetsu Financial Group Inc | Goldman Sachs | 760 | (100) | East Japan Railway Co | Bank of America Merrill Lynch | 297 |
| 1.100 | Daiwa House Industry Co Ltd | Morgan Stanley | 424 | (300) | East Japan Railway Co | Goldman Sachs | 890 |
| (4) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 53 | 400 | Ebara Corp | Goldman Sachs | 485 |
| (5) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 56 | 1.200 | Ebara Corp | Morgan Stanley | 86 |
| (10) | Daiwa House Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 178 | (1.700) | EDION Corp | Bank of America Merrill Lynch | 24 |
| (10) | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 428 | (1.100) | EDION Corp | Goldman Sachs | 16 |
| (1) | Daiwa Office Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 43 | 600 | eGuarantee Inc | Bank of America Merrill Lynch | (479) |
| (2.400) | Daiwa Securities Group Inc | Goldman Sachs | 14 | 1.000 | eGuarantee Inc | Goldman Sachs | (849) |
| (1.900) | Daiwa Securities Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (473) | 1.700 | Eiken Chemical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.116) |
| (17) | Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT) | Goldman Sachs | (390) | 1.400 | Eiken Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | (919) |
| (14) | Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 310 | 100 | Eisai Co Ltd | Goldman Sachs | 481 |
| (300) | Daiwabo Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.448 | 100 | Eizo Corp | Bank of America Merrill Lynch | (125) |
| (1.400) | Daiwabo Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 2.071 | 100 | Eizo Corp | Goldman Sachs | 29 |
| (3.000) | DCM Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.983 | 1.800 | Elan Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.939) |
| (4.000) | Demae-Can Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (371) | 2.500 | Elan Corp | Goldman Sachs | (2.693) |
| 200 | DeNA Co Ltd | Goldman Sachs | (298) | 3.400 | Elecom Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.790 |
| 3.700 | DeNA Co Ltd | Morgan Stanley | (3.775) | 4.500 | Elecom Co Ltd | Goldman Sachs | 3.692 |
| 800 | Denka Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (634) | (1.000) | Electric Power Development Co Ltd | Morgan Stanley | 549 |
| 400 | Denka Co Ltd | Goldman Sachs | (317) | (700) | EM Systems Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (120) |
| 400 | Denka Co Ltd | Morgan Stanley | (400) | 700 | en Japan Inc | Goldman Sachs | (504) |
| (600) | Descente Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.841 | (2.600) | ENEOS Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 393 |
| (700) | Descente Ltd | Goldman Sachs | 2.147 | (2.300) | ENEOS Holdings Inc | Morgan Stanley | 162 |
| (500) | Descente Ltd | Morgan Stanley | 1.338 | (400) | eRex Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 656 |
| (800) | Dexerials Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.580) | (800) | eRex Co Ltd | Goldman Sachs | 1.313 |
| (3.000) | Dexerials Corp | Goldman Sachs | (9.674) | (1.400) | ES-Con Japan Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 879 |
| 800 | Digital Arts Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.370 | (2.400) | ES-Con Japan Ltd | Goldman Sachs | 1.507 |
| 700 | Digital Arts Inc | Goldman Sachs | 1.199 | 3.100 | euglena Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (12) |
| 200 | Digital Garage Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.199) | 2.700 | euglena Co Ltd | Goldman Sachs | 43 |
| 400 | Digital Garage Inc | Goldman Sachs | (2.397) | (400) | Exedy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 43 |
| 700 | dip Corp | Bank of America Merrill Lynch | (225) | (3.000) | Exedy Corp | Goldman Sachs | 321 |
| 500 | DMG Mori Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 499 | 700 | EXEO Group Inc | Goldman Sachs | (85) |
| 500 | DMG Mori Co Ltd | Goldman Sachs | 499 | 2.300 | EXEO Group Inc | Morgan Stanley | (804) |
| 5.900 | DMG Mori Co Ltd | Morgan Stanley | 1.768 | 700 | FCC Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (255) |
| 2.000 | Doshisha Co Ltd | Goldman Sachs | (14) | 3.500 | FCC Co Ltd | Goldman Sachs | (1.282) |
| 500 | Doutor Nichires Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (334) | (400) | Ferrotec Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (585) |
| | | | | (1.300) | Ferrotec Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.177) |
| | | | | 5.700 | Financial Partners Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.000) |
| | | | | 2.500 | Financial Partners Group Co Ltd | Goldman Sachs | (412) |
| | | | | (300) | Food & Life Cos Ltd | Goldman Sachs | 332 |
| | | | | (300) | Food & Life Cos Ltd | Morgan Stanley | 321 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (600) | FP Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.100 | 600 | Future Corp | Goldman Sachs | — |
| (600) | FP Corp | Goldman Sachs | 1.100 | (100) | Fuyo General Lease Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 136 |
| (800) | FP Corp | Morgan Stanley | 868 | (100) | Fuyo General Lease Co Ltd | Goldman Sachs | 136 |
| (100) | Freee KK | Bank of America Merrill Lynch | 453 | (500) | Fuyo General Lease Co Ltd | Morgan Stanley | 1.320 |
| 600 | Fuji Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (176) | 400 | G-7 Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (479) |
| 1.000 | Fuji Co Ltd | Goldman Sachs | (293) | 400 | Geo Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (465) |
| 400 | Fuji Corp | Goldman Sachs | (283) | 900 | Geo Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.047) |
| 600 | Fuji Electric Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 471 | 1.000 | Giken Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.677) |
| 400 | Fuji Electric Co Ltd | Goldman Sachs | 314 | 900 | Giken Ltd | Goldman Sachs | (1.509) |
| 200 | Fuji Electric Co Ltd | Morgan Stanley | (428) | (300) | GLOBERIDE Inc | Bank of America Merrill Lynch | 456 |
| (1.900) | Fuji Kyuko Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 5.151 | (1.900) | GLOBERIDE Inc | Goldman Sachs | 2.887 |
| 4.200 | Fuji Media Holdings Inc | Goldman Sachs | 719 | 500 | Glory Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (306) |
| 9.100 | Fuji Media Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.493) | 800 | Glory Ltd | Goldman Sachs | (592) |
| (100) | Fuji Seal International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 68 | (6) | GLP J-Reit (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 84 |
| (700) | Fuji Seal International Inc | Goldman Sachs | 474 | (3) | GLP J-Reit (REIT) | Goldman Sachs | (54) |
| (200) | Fuji Soft Inc | Bank of America Merrill Lynch | (314) | (1.300) | GMO Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (46) |
| (100) | Fuji Soft Inc | Goldman Sachs | (157) | (3.100) | GMO Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | (111) |
| (1.100) | Fujicco Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 549 | (700) | GMO GlobalSign Holdings KK | Bank of America Merrill Lynch | 1.691 |
| (600) | Fujicco Co Ltd | Goldman Sachs | 300 | 300 | GMO internet group Inc | Goldman Sachs | (340) |
| 600 | FUJIFILM Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.228 | 200 | GMO internet group Inc | Morgan Stanley | (205) |
| 1.200 | FUJIFILM Holdings Corp | Goldman Sachs | 6.455 | 700 | GMO Payment Gateway Inc | Morgan Stanley | (1.448) |
| 600 | FUJIFILM Holdings Corp | Morgan Stanley | 1.023 | 1.300 | GNI Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (130) |
| 2.900 | Fujikura Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.538 | 1.000 | GNI Group Ltd | Goldman Sachs | (100) |
| 1.200 | Fujikura Ltd | Goldman Sachs | 1.464 | 200 | Goldcrest Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (33) |
| 1.400 | Fujikura Ltd | Morgan Stanley | 839 | 2.300 | Goldcrest Co Ltd | Goldman Sachs | (377) |
| 500 | Fujimi Inc | Goldman Sachs | 2.711 | (300) | Goldwin Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.926 |
| 100 | Fujimori Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 82 | (800) | Goldwin Inc | Goldman Sachs | 5.137 |
| (900) | Fujio Food Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (283) | 900 | Gree Inc | Bank of America Merrill Lynch | (141) |
| (3.400) | Fujio Food Group Inc | Goldman Sachs | (1.067) | 1.700 | Gree Inc | Goldman Sachs | (267) |
| (600) | Fujitec Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 407 | (900) | GS Yuasa Corp | Bank of America Merrill Lynch | 302 |
| (1.000) | Fujitec Co Ltd | Goldman Sachs | 678 | (900) | GS Yuasa Corp | Goldman Sachs | 302 |
| (1.800) | Fujitsu General Ltd | Morgan Stanley | 1.413 | (200) | GS Yuasa Corp | Morgan Stanley | 96 |
| 27 | Fukuoka Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 267 | 1.000 | G-Tekt Corp | Bank of America Merrill Lynch | (549) |
| 29 | Fukuoka Corp (REIT) | Goldman Sachs | 247 | (2.000) | G-Tekt Corp | Goldman Sachs | (824) |
| (2.500) | Fukuoka Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (89) | (2.000) | GungHo Online Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.769 |
| (500) | Fukuoka Financial Group Inc | Morgan Stanley | 153 | (100) | GungHo Online Entertainment Inc | Goldman Sachs | 88 |
| (300) | Fukushima Galilei Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 364 | (800) | GungHo Online Entertainment Inc | Morgan Stanley | 1.107 |
| (500) | Fukushima Galilei Co Ltd | Goldman Sachs | 606 | 5.000 | Gunma Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (400) | Fukuyama Transporting Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.207 | 3.000 | Gunma Bank Ltd | Goldman Sachs | — |
| (400) | Fukuyama Transporting Co Ltd | Goldman Sachs | 1.370 | 3.000 | H2O Retailing Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.440) |
| 500 | FULLCAST Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (774) | 2.000 | H2O Retailing Corp | Goldman Sachs | (1.614) |
| 1.100 | Funai Soken Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 447 | (1.100) | Hachijuni Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 110 |
| 1.600 | Funai Soken Holdings Inc | Goldman Sachs | 651 | (600) | Hachijuni Bank Ltd | Goldman Sachs | 60 |
| (500) | Furukawa Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (93) | (3.200) | Hakuhodo DY Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.260 |
| (300) | Furukawa Co Ltd | Goldman Sachs | (56) | (2.200) | Hakuhodo DY Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.554 |
| 300 | Fuso Chemical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 856 | (300) | Hakuhodo DY Holdings Inc | Morgan Stanley | 227 |
| 100 | Fuso Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | 285 | (500) | Hakuto Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.231) |
| 200 | Future Corp | Bank of America Merrill Lynch | — | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|---|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 200 | Halows Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (57) | 900 | Hokuriku Electric Power Co | Goldman Sachs | 571 |
| 200 | Halows Co Ltd | Goldman Sachs | (57) | (500) | Hokuto Corp | Bank of America Merrill Lynch | 93 |
| 300 | Hamamatsu Photonics KK | Bank of America Merrill Lynch | (86) | (2.700) | Hokuto Corp | Goldman Sachs | 757 |
| 300 | Hamamatsu Photonics KK | Goldman Sachs | (86) | (100) | Horiba Ltd | Goldman Sachs | (164) |
| (700) | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 75 | (2) | Hoshino Resorts Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 528 |
| (1.000) | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Goldman Sachs | 107 | (1) | Hoshino Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | 264 |
| (500) | Hankyu Hanshin Holdings Inc | Morgan Stanley | 517 | (500) | Hoshizaki Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.320 |
| (2) | Hankyu Hanshin Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 74 | (2.500) | Hoshizaki Corp | Goldman Sachs | 6.599 |
| (5) | Hankyu Hanshin Inc (REIT) | Goldman Sachs | 186 | (2.300) | Hoshizaki Corp | Morgan Stanley | 5.251 |
| (200) | Hanwa Co Ltd | Goldman Sachs | 328 | (700) | Hosiden Corp | Bank of America Merrill Lynch | 501 |
| (100) | Harmonic Drive Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (325) | (900) | Hosiden Corp | Goldman Sachs | 819 |
| (200) | Harmonic Drive Systems Inc | Goldman Sachs | (649) | 200 | House Foods Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 78 |
| (4.400) | Haseko Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.915 | 700 | House Foods Group Inc | Goldman Sachs | 275 |
| (3.600) | Haseko Corp | Goldman Sachs | 1.567 | 500 | House Foods Group Inc | Morgan Stanley | 36 |
| (500) | Haseko Corp | Morgan Stanley | 214 | (3.200) | Hyakugo Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 228 |
| 1.000 | Hazama Ando Corp | Bank of America Merrill Lynch | 16 | (8.000) | Hyakugo Bank Ltd | Goldman Sachs | 571 |
| 500 | Hazama Ando Corp | Goldman Sachs | 12 | (2.100) | Ibiden Co Ltd | Goldman Sachs | (23.372) |
| (1.600) | Heiwa Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.425 | (1.600) | Ibiden Co Ltd | Morgan Stanley | (13.013) |
| (1.000) | Heiwa Corp | Goldman Sachs | 2.140 | (100) | Ichibanya Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 50 |
| (700) | Heiwa Corp | Morgan Stanley | 1.343 | 12.500 | Ichigo Inc | Bank of America Merrill Lynch | (241) |
| 100 | Heiwa Real Estate Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (193) | 14.000 | Ichigo Inc | Goldman Sachs | (310) |
| 100 | Heiwa Real Estate Co Ltd | Goldman Sachs | (193) | (200) | IDOM Inc | Bank of America Merrill Lynch | 61 |
| (20) | Heiwa Real Estate Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.510 | 400 | IHI Corp | Goldman Sachs | (357) |
| (34) | Heiwa Real Estate Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.538 | 300 | IHI Corp | Morgan Stanley | (417) |
| (700) | Heiwado Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 215 | (700) | Iida Group Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 844 |
| (600) | Heiwado Co Ltd | Goldman Sachs | 184 | (1.100) | Iida Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 1.326 |
| 700 | Hiday Hidaka Corp | Bank of America Merrill Lynch | (382) | (1.400) | Iida Group Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 2.377 |
| 800 | Hiday Hidaka Corp | Goldman Sachs | (454) | (1.800) | Iino Kaiun Kaisha Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (65) |
| (300) | Hikari Tsushin Inc | Goldman Sachs | (2.697) | (1.400) | Iino Kaiun Kaisha Ltd | Goldman Sachs | (15) |
| (100) | Hirata Corp | Bank of America Merrill Lynch | (556) | 900 | Inaba Denki Sangyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (557) |
| (200) | Hirata Corp | Goldman Sachs | (1.113) | 100 | Inaba Denki Sangyo Co Ltd | Goldman Sachs | (76) |
| 300 | HIS Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (42) | (300) | Inabata & Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 161 |
| 600 | HIS Co Ltd | Goldman Sachs | (37) | (1.400) | Inabata & Co Ltd | Goldman Sachs | 749 |
| 300 | Hitachi Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 163 | (1.100) | Inageya Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (173) |
| 200 | Hitachi Ltd | Goldman Sachs | 108 | (300) | Inageya Co Ltd | Goldman Sachs | (47) |
| 600 | Hitachi Ltd | Morgan Stanley | (840) | (57) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (569) |
| 100 | Hitachi Zosen Corp | Bank of America Merrill Lynch | (6) | (13) | Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (408) |
| 2.300 | Hitachi Zosen Corp | Goldman Sachs | (131) | 1.300 | Infocom Corp | Goldman Sachs | (417) |
| (100) | Hogy Medical Co Ltd | Goldman Sachs | 178 | 5.200 | Infomart Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.373) |
| (4.900) | Hokkaido Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.014) | 7.400 | Infomart Corp | Goldman Sachs | (1.953) |
| (3.300) | Hokkaido Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | (683) | 300 | Information Services International-Dentsu Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (300) |
| (400) | Hokkoku Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 628 | 300 | Information Services International-Dentsu Ltd | Goldman Sachs | (300) |
| (4.300) | Hokuetsu Corp | Bank of America Merrill Lynch | 828 | 600 | Information Services International-Dentsu Ltd | Morgan Stanley | (1.027) |
| (6.700) | Hokuetsu Corp | Goldman Sachs | 1.291 | 3.224 | INFRONEER Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (483) |
| (1.800) | Hokuhoku Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (9) | 3.900 | INFRONEER Holdings Inc | Goldman Sachs | (584) |
| (5.000) | Hokuhoku Financial Group Inc | Goldman Sachs | (56) | 3.100 | INFRONEER Holdings Inc | Morgan Stanley | (796) |
| | | | | (2.200) | Inpex Corp | Bank of America Merrill Lynch | (251) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------------------------|---|--------------------------|---|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (9.100) | Inpex Corp | Goldman Sachs | (1.039) | (88) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (251) |
| (1.100) | Insource Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 535 | 800 | Japan Lifeline Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (314) |
| (1.200) | Insource Co Ltd | Goldman Sachs | 887 | 700 | Japan Lifeline Co Ltd | Goldman Sachs | (275) |
| 1.600 | Internet Initiative Japan Inc | Goldman Sachs | (2.454) | (2) | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (43) |
| 200 | Internet Initiative Japan Inc | Morgan Stanley | (288) | (4) | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | Goldman Sachs | (86) |
| (100) | Iriso Electronics Co Ltd | Goldman Sachs | 45 | (7) | Japan Logistics Fund Inc (REIT) | Morgan Stanley | (474) |
| 300 | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (26) | 200 | Japan Material Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 509 |
| 100 | ITOCHU Corp | Morgan Stanley | (48) | 300 | Japan Material Co Ltd | Goldman Sachs | 764 |
| (400) | Itochu Enex Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 228 | (18) | Japan Metropolitan Fund Invest (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 103 |
| (500) | Itochu Enex Co Ltd | Goldman Sachs | 285 | (17) | Japan Metropolitan Fund Invest (REIT) | Goldman Sachs | 97 |
| 2.100 | Itochu Techno-Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.648 | (2.900) | Japan Post Bank Co Ltd | Goldman Sachs | 662 |
| 2.900 | Itochu Techno-Solutions Corp | Goldman Sachs | 2.276 | (3.700) | Japan Post Insurance Co Ltd | Morgan Stanley | 3.141 |
| 1.900 | Itochu Techno-Solutions Corp | Morgan Stanley | 542 | (3) | Japan Prime Realty Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (203) |
| (300) | Itochu-Shokuhin Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 535 | (1) | Japan Prime Realty Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (68) |
| (300) | Itoham Yonekyu Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 94 | (24) | Japan Real Estate Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 856 |
| (600) | Itoham Yonekyu Holdings Inc | Morgan Stanley | 163 | (23) | Japan Real Estate Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 679 |
| (500) | Iwatani Corp | Bank of America Merrill Lynch | 571 | (18) | Japan Real Estate Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 701 |
| (1.300) | Iwatani Corp | Goldman Sachs | 1.484 | 100 | Japan Securities Finance Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 44 |
| (2.800) | Iwatani Corp | Morgan Stanley | 3.995 | (600) | Japan Wool Textile Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 261 |
| (4.500) | Iyogin Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.156 | (500) | Japan Wool Textile Co Ltd | Goldman Sachs | 218 |
| (4.200) | Iyogin Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.079 | (1.700) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.268) |
| (3.400) | Izumi Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.426 | (600) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | Goldman Sachs | (800) |
| (800) | Izumi Co Ltd | Goldman Sachs | 571 | (1.000) | JCR Pharmaceuticals Co Ltd | Morgan Stanley | 285 |
| (2.400) | Izumi Co Ltd | Morgan Stanley | 1.969 | 800 | JCU Corp | Bank of America Merrill Lynch | 970 |
| 6.700 | J Front Retailing Co Ltd | Goldman Sachs | (3.585) | 1.000 | JCU Corp | Goldman Sachs | 1.213 |
| 14.300 | J Front Retailing Co Ltd | Morgan Stanley | (11.222) | (800) | JDC Corp | Bank of America Merrill Lynch | 320 |
| (1.200) | J Trust Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 325 | (1.600) | JDC Corp | Goldman Sachs | 639 |
| (800) | J Trust Co Ltd | Goldman Sachs | 217 | (100) | Jeol Ltd | Morgan Stanley | (449) |
| 1.100 | JAC Recruitment Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.354) | 500 | JINS Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (71) |
| 2.900 | JAC Recruitment Co Ltd | Goldman Sachs | (6.207) | 1.200 | JINS Holdings Inc | Goldman Sachs | (171) |
| (200) | Jaccs Co Ltd | Goldman Sachs | 193 | (1.600) | JMDC Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.484 |
| 2.800 | JAFCO Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (439) | (1.300) | JMDC Inc | Goldman Sachs | 1.206 |
| 4.000 | JAFCO Group Co Ltd | Goldman Sachs | (628) | (600) | JMDC Inc | Morgan Stanley | 128 |
| (100) | Japan Airport Terminal Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 228 | (1.300) | J-Oil Mills Inc | Bank of America Merrill Lynch | 538 |
| (1.200) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (171) | (600) | J-Oil Mills Inc | Goldman Sachs | 248 |
| (1.000) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | Goldman Sachs | (143) | (700) | Joshin Denki Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 290 |
| (4.400) | Japan Aviation Electronics Industry Ltd | Morgan Stanley | 4.395 | (1.300) | Joshin Denki Co Ltd | Goldman Sachs | 538 |
| 500 | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (432) | 700 | Joyful Honda Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (449) |
| 600 | Japan Elevator Service Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (367) | 400 | Joyful Honda Co Ltd | Goldman Sachs | (257) |
| (4) | Japan Excellent Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (183) | (100) | JTOWER Inc | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| (5) | Japan Excellent Inc (REIT) | Goldman Sachs | (233) | (600) | JTOWER Inc | Goldman Sachs | (771) |
| (1.100) | Japan Exchange Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (357) | (200) | Juroku Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 93 |
| (4.000) | Japan Exchange Group Inc | Goldman Sachs | (1.298) | (700) | Juroku Financial Group Inc | Goldman Sachs | 325 |
| (2.000) | Japan Exchange Group Inc | Morgan Stanley | 771 | | | | |
| (31) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (177) | | | | |
| (24) | Japan Hotel Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (137) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|---|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (100) | Justsystems Corp | Bank of America Merrill Lynch | 57 | (400) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Goldman Sachs | (114) |
| (400) | Justsystems Corp | Goldman Sachs | 228 | (200) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Morgan Stanley | 114 |
| (1.200) | Justsystems Corp | Morgan Stanley | 471 | (1.700) | Keiyo Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 703 |
| 400 | Kadokawa Corp | Bank of America Merrill Lynch | (100) | (2.500) | Keiyo Bank Ltd | Goldman Sachs | 1.034 |
| 800 | Kadokawa Corp | Goldman Sachs | (200) | (1.300) | Keiyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 421 |
| 700 | Kadokawa Corp | Morgan Stanley | (674) | (3.100) | Keiyo Co Ltd | Goldman Sachs | 1.019 |
| 500 | Kaga Electronics Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 321 | (3) | Kenedix Residential Next Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 4 |
| 400 | Kaga Electronics Co Ltd | Goldman Sachs | 257 | 1.700 | Kewpie Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.637) |
| (500) | Kagome Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 517 | 600 | Kewpie Corp | Goldman Sachs | (578) |
| 1.700 | Kakaku.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | (182) | 500 | Kewpie Corp | Morgan Stanley | (332) |
| 4.100 | Kakaku.com Inc | Goldman Sachs | (439) | 400 | KFC Holdings Japan Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (168) |
| 1.600 | Kakaku.com Inc | Morgan Stanley | (753) | 300 | KFC Holdings Japan Ltd | Goldman Sachs | (126) |
| (500) | Kameda Seika Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 963 | (400) | KH Neochem Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 274 |
| (600) | Kameda Seika Co Ltd | Goldman Sachs | 1.078 | (300) | KH Neochem Co Ltd | Goldman Sachs | 205 |
| 300 | Kamigumi Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (64) | (5.000) | Kikkoman Corp | Morgan Stanley | 6.064 |
| 100 | Kamigumi Co Ltd | Morgan Stanley | (32) | 1.800 | Kinden Corp | Bank of America Merrill Lynch | (925) |
| (300) | Kanamoto Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 105 | 4.200 | Kinden Corp | Goldman Sachs | (2.157) |
| (600) | Kanamoto Co Ltd | Goldman Sachs | 210 | 1.600 | Kinden Corp | Morgan Stanley | (582) |
| 7.300 | Kandenko Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.854) | 100 | Kintetsu Department Store Co Ltd | Goldman Sachs | (60) |
| 2.900 | Kandenko Co Ltd | Goldman Sachs | (1.531) | (800) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 913 |
| 7.100 | Kandenko Co Ltd | Morgan Stanley | (3.748) | (600) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 685 |
| 400 | Kaneka Corp | Bank of America Merrill Lynch | (300) | (800) | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 1.398 |
| 300 | Kaneka Corp | Goldman Sachs | (225) | 2.800 | Kirin Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (2.088) |
| 300 | Kaneka Corp | Morgan Stanley | (417) | (3.600) | Kisoji Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.981 |
| 1.700 | Kanematsu Corp | Bank of America Merrill Lynch | (837) | (900) | Kisoji Co Ltd | Goldman Sachs | 995 |
| 2.800 | Kanematsu Corp | Goldman Sachs | (1.678) | 700 | Kissei Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (469) |
| (1.600) | Kansai Paint Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 377 | 400 | Kissei Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | (268) |
| (1.200) | Kansai Paint Co Ltd | Goldman Sachs | 283 | (600) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 278 |
| (1.500) | Kanto Denka Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 717 | (3.000) | Ki-Star Real Estate Co Ltd | Goldman Sachs | 1.391 |
| (1.000) | Kanto Denka Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | 1.177 | 1.400 | Kitz Corp | Bank of America Merrill Lynch | 408 |
| 600 | Kao Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.644) | 1.700 | Kitz Corp | Goldman Sachs | 398 |
| (2.600) | Kappa Create Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.280 | (3.100) | Kiyo Bank Ltd | Goldman Sachs | 3.074 |
| (1.700) | Kappa Create Co Ltd | Goldman Sachs | 837 | (400) | Koa Corp | Bank of America Merrill Lynch | 29 |
| (1.200) | Katakura Industries Co Ltd | Goldman Sachs | 1.413 | (1.400) | Koa Corp | Goldman Sachs | 100 |
| 300 | Kato Sangyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (75) | (100) | Kobe Bussan Co Ltd | Goldman Sachs | 111 |
| 200 | Kato Sangyo Co Ltd | Goldman Sachs | (50) | (5.100) | Kobe Steel Ltd | Goldman Sachs | 1.492 |
| 2.100 | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.996) | (10.000) | Kobe Steel Ltd | Morgan Stanley | (143) |
| 1.600 | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd | Morgan Stanley | (2.511) | 500 | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (457) |
| 100 | KDDI Corp | Bank of America Merrill Lynch | (151) | 1.100 | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (1.005) |
| 100 | KDDI Corp | Goldman Sachs | (151) | 800 | Koei Tecmo Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (514) |
| (100) | KeePer Technical Laboratory Co Ltd | Morgan Stanley | 185 | (300) | Kohnan Shoji Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 503 |
| (100) | Keihan Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 582 | (1.200) | Kohnan Shoji Co Ltd | Goldman Sachs | 2.012 |
| 1.700 | Keihanshin Building Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 308 | (200) | Koito Manufacturing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 101 |
| 900 | Keihanshin Building Co Ltd | Goldman Sachs | 556 | 2.100 | Kokuyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.217) |
| (300) | Keio Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.113 | 2.500 | Kokuyo Co Ltd | Goldman Sachs | (2.640) |
| (600) | Keio Corp | Goldman Sachs | 1.113 | 3.500 | Kokuyo Co Ltd | Morgan Stanley | (3.196) |
| (400) | Keio Corp | Morgan Stanley | (29) | | | | |
| (100) | Keisei Electric Railway Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (100) | Komatsu Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 6 | (1.500) | Kyushu Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | (171) |
| (700) | Komatsu Ltd | Goldman Sachs | 40 | (3.700) | Kyushu Financial Group Inc | Morgan Stanley | (238) |
| 900 | KOMEDA Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (58) | (1.600) | Kyushu Railway Co | Bank of America Merrill Lynch | 2.020 |
| 1.400 | KOMEDA Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (90) | (1.600) | Kyushu Railway Co | Goldman Sachs | 2.020 |
| (1.800) | Komeri Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.762 | (100) | Kyushu Railway Co | Morgan Stanley | 98 |
| (1.900) | Komeri Co Ltd | Goldman Sachs | 1.799 | (20) | LaSalle Logiport (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (300) |
| (1.500) | Konishi Co Ltd | Goldman Sachs | 1.680 | (18) | LaSalle Logiport (REIT) | Goldman Sachs | (270) |
| 500 | Konoike Transport Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (599) | (14) | LaSalle Logiport (REIT) | Morgan Stanley | (509) |
| 2.500 | Konoike Transport Co Ltd | Goldman Sachs | (2.996) | 3.300 | Lawson Inc | Goldman Sachs | (5.982) |
| 100 | Kose Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.027) | 1.100 | Lawson Inc | Morgan Stanley | (3.278) |
| 200 | Kose Corp | Goldman Sachs | (2.055) | (3.500) | Leopalace21 Corp | Bank of America Merrill Lynch | 624 |
| 300 | Kose Corp | Morgan Stanley | (3.061) | (6.300) | Leopalace21 Corp | Goldman Sachs | 1.124 |
| 3.700 | Koshidaka Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 28 | 500 | Life Corp | Bank of America Merrill Lynch | (795) |
| 2.400 | Koshidaka Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (26) | 1.700 | Life Corp | Goldman Sachs | (2.705) |
| (100) | Kotobuki Spirits Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (264) | (200) | LIFENET INSURANCE Co | Bank of America Merrill Lynch | 198 |
| (500) | Kotobuki Spirits Co Ltd | Goldman Sachs | (1.320) | 2.800 | Link And Motivation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (739) |
| (800) | Kotobuki Spirits Co Ltd | Morgan Stanley | 1.941 | 1.600 | Link And Motivation Inc | Goldman Sachs | (422) |
| 1.300 | K's Holdings Corp | Goldman Sachs | (872) | 400 | Lintec Corp | Bank of America Merrill Lynch | (137) |
| 2.500 | K's Holdings Corp | Morgan Stanley | (1.427) | 400 | Lintec Corp | Goldman Sachs | (137) |
| (600) | Kumagai Gumi Co Ltd | Goldman Sachs | (300) | 200 | Lintec Corp | Morgan Stanley | (114) |
| 2.000 | Kumiai Chemical Industry Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (300) | 4.100 | Lion Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.901) |
| 1.500 | Kumiai Chemical Industry Co Ltd | Goldman Sachs | (225) | 2.700 | Lion Corp | Goldman Sachs | (1.252) |
| (1.220) | Kura Sushi Inc | Bank of America Merrill Lynch | 367 | 4.700 | Lion Corp | Morgan Stanley | (3.286) |
| (2.100) | Kura Sushi Inc | Goldman Sachs | 1.873 | (100) | LITALICO Inc | Bank of America Merrill Lynch | 217 |
| 700 | Kuraray Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 74 | 800 | Lixil Corp | Morgan Stanley | (1.102) |
| 1.300 | Kuraray Co Ltd | Goldman Sachs | 223 | 600 | M3 Inc | Bank of America Merrill Lynch | 120 |
| 300 | Kuraray Co Ltd | Morgan Stanley | (21) | 1.200 | M3 Inc | Goldman Sachs | 240 |
| 400 | Kureha Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.655) | (400) | Macnica Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.983) |
| 500 | Kureha Corp | Goldman Sachs | (2.069) | (400) | Macnica Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.983) |
| (700) | Kurita Water Industries Ltd | Goldman Sachs | (799) | 300 | Maeda Kosen Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (268) |
| (800) | Kurita Water Industries Ltd | Morgan Stanley | 1.084 | 400 | Maeda Kosen Co Ltd | Goldman Sachs | (357) |
| 200 | Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (656) | 100 | Makino Milling Machine Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 296 |
| (800) | KYB Corp | Bank of America Merrill Lynch | 913 | (400) | Makita Corp | Bank of America Merrill Lynch | (71) |
| (1.800) | KYB Corp | Goldman Sachs | 2.055 | (1.000) | Makita Corp | Goldman Sachs | (178) |
| 500 | Kyocera Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.883 | (100) | Management Solutions Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 219 |
| 700 | Kyocera Corp | Goldman Sachs | 2.637 | (600) | Management Solutions Co Ltd | Goldman Sachs | 1.314 |
| 1.400 | Kyocera Corp | Morgan Stanley | 3.176 | 500 | Mandom Corp | Bank of America Merrill Lynch | (624) |
| (100) | Kyoei Steel Ltd | Goldman Sachs | (9) | 900 | Mani Inc | Goldman Sachs | (565) |
| 2.400 | Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | (1.883) | 2.700 | Mani Inc | Morgan Stanley | (2.003) |
| (800) | Kyorin Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 74 | (2.300) | Marubeni Corp | Bank of America Merrill Lynch | (632) |
| 1.100 | Kyoritsu Maintenance Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.610) | (2.100) | Marubeni Corp | Goldman Sachs | (577) |
| 900 | Kyoritsu Maintenance Co Ltd | Goldman Sachs | (2.954) | (200) | Maruha Nichiro Corp | Bank of America Merrill Lynch | 255 |
| 900 | Kyowa Kirin Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (161) | (1.400) | Maruha Nichiro Corp | Goldman Sachs | 1.788 |
| 700 | Kyowa Kirin Co Ltd | Goldman Sachs | (125) | (200) | Marui Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 136 |
| 900 | Kyowa Kirin Co Ltd | Morgan Stanley | (462) | (100) | Marui Group Co Ltd | Goldman Sachs | 68 |
| (300) | Kyudenko Corp | Bank of America Merrill Lynch | (128) | (500) | Marui Group Co Ltd | Morgan Stanley | 417 |
| (100) | Kyudenko Corp | Goldman Sachs | (43) | | | | |
| (100) | Kyushu Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3) | | | | |
| (3.600) | Kyushu Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | (103) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------------|-----------------|---|--------------------------|--|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 300 | Maruichi Steel Tube Ltd | Goldman Sachs | (246) | 200 | Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 457 |
| 500 | Maruichi Steel Tube Ltd | Morgan Stanley | (321) | (31) | Mirai Corp (REIT) | Bank of America | (286) |
| (100) | MARUKA FURUSATO Corp | Bank of America | | (10) | Mirai Corp (REIT) | Goldman Sachs | (78) |
| (400) | Maruwa Co Ltd | Merrill Lynch | 322 | (200) | MIRAIT ONE corp | Bank of America | (17) |
| 300 | Maruzen Showa Unyu Co Ltd | Goldman Sachs | (4.680) | (1.000) | MIRAIT ONE corp | Goldman Sachs | (86) |
| 100 | Maruzen Showa Unyu Co Ltd | Bank of America | | (600) | Mitani Sekisan Co Ltd | Bank of America | (364) |
| (2.500) | Matsui Securities Co Ltd | Merrill Lynch | (268) | 3.100 | Mitsubishi Chemical Group Corp | Merrill Lynch | (441) |
| (4.000) | Matsui Securities Co Ltd | Goldman Sachs | 71 | 3.000 | Mitsubishi Chemical Group Corp | Goldman Sachs | (357) |
| (4.900) | Matsui Securities Co Ltd | Morgan Stanley | 114 | 8.800 | Mitsubishi Chemical Group Corp | Morgan Stanley | (1.894) |
| (900) | MatsukiyoCocokara & Co | Goldman Sachs | 454 | 600 | Mitsubishi Corp | Goldman Sachs | 852 |
| (400) | MatsukiyoCocokara & Co | Morgan Stanley | (963) | 300 | Mitsubishi Corp | Morgan Stanley | (88) |
| 100 | Matsuyafoods Holdings Co Ltd | Bank of America | 1.056 | 2.800 | Mitsubishi Electric Corp | Morgan Stanley | 230 |
| 100 | Max Co Ltd | Merrill Lynch | (125) | 3.300 | Mitsubishi Estate Co Ltd | Goldman Sachs | (942) |
| 600 | Max Co Ltd | Bank of America | (300) | 5.800 | Mitsubishi Estate Co Ltd | Morgan Stanley | (2.048) |
| 400 | Maxell Ltd | Merrill Lynch | (126) | (1) | Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| 500 | Maxell Ltd | Goldman Sachs | (200) | (7) | Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT) | Merrill Lynch | (29) |
| (800) | Mazda Motor Corp | Bank of America | 80 | 2.800 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Goldman Sachs | (200) |
| (300) | Mazda Motor Corp | Merrill Lynch | 30 | 4.700 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Bank of America | (40) |
| (2.000) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Morgan Stanley | 1.142 | 5.200 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | Goldman Sachs | (67) |
| (900) | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | Bank of America | 514 | 400 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Morgan Stanley | (853) |
| 300 | MCJ Co Ltd | Merrill Lynch | (26) | 400 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Bank of America | 782 |
| 200 | MCJ Co Ltd | Goldman Sachs | (17) | 400 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | Morgan Stanley | 264 |
| (3.200) | Mebuki Financial Group Inc | Bank of America | 457 | (400) | Mitsubishi Logisnext Co Ltd | Bank of America | (77) |
| (3.300) | Mebuki Financial Group Inc | Merrill Lynch | 471 | (500) | Mitsubishi Logisnext Co Ltd | Goldman Sachs | (96) |
| (1.200) | Medley Inc | Bank of America | (8.775) | 200 | Mitsubishi Materials Corp | Morgan Stanley | (61) |
| 200 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | Merrill Lynch | (221) | 600 | Mitsubishi Pencil Co Ltd | Bank of America | (745) |
| 1.100 | Megmilk Snow Brand Co Ltd | Goldman Sachs | (1.216) | 1.200 | Mitsubishi Pencil Co Ltd | Goldman Sachs | (1.490) |
| 800 | Meidensha Corp | Bank of America | — | 800 | Mitsubishi Shokuhin Co Ltd | Bank of America | 114 |
| 700 | Meidensha Corp | Merrill Lynch | — | 1.300 | Mitsubishi Shokuhin Co Ltd | Merrill Lynch | 186 |
| (400) | Meiko Electronics Co Ltd | Goldman Sachs | 231 | (100) | Mitsuboshi Belting Ltd | Bank of America | 90 |
| (800) | Meiko Electronics Co Ltd | Merrill Lynch | 462 | (100) | Mitsuboshi Belting Ltd | Goldman Sachs | 46 |
| 1.800 | Meitec Corp | Bank of America | 308 | 700 | Mitsui & Co Ltd | Goldman Sachs | 644 |
| 2.100 | Meitec Corp | Merrill Lynch | 360 | 1.200 | Mitsui & Co Ltd | Morgan Stanley | (188) |
| (100) | Mercari Inc | Goldman Sachs | (5) | 1.500 | Mitsui Chemicals Inc | Bank of America | 161 |
| (1.600) | Mercari Inc | Merrill Lynch | (2.157) | 800 | Mitsui Chemicals Inc | Merrill Lynch | 86 |
| 400 | METAWATER Co Ltd | Goldman Sachs | (228) | 1.400 | Mitsui Chemicals Inc | Goldman Sachs | (599) |
| 400 | METAWATER Co Ltd | Bank of America | (228) | 1.100 | Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd | Bank of America | 1.381 |
| (500) | Micronics Japan Co Ltd | Merrill Lynch | (1.245) | 700 | Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd | Merrill Lynch | 879 |
| (400) | Micronics Japan Co Ltd | Goldman Sachs | (996) | 300 | Mitsui Fudosan Co Ltd | Goldman Sachs | (15) |
| (100) | Midac Holdings Co Ltd | Bank of America | 312 | 4.100 | Mitsui Fudosan Co Ltd | Bank of America | (205) |
| (1.100) | Mie Kotsu Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 157 | 2.700 | Mitsui Fudosan Co Ltd | Goldman Sachs | (1.387) |
| 100 | Milbon Co Ltd | Bank of America | (763) | (14) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | Bank of America | 1.598 |
| 500 | Milbon Co Ltd | Merrill Lynch | (3.817) | (6) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | Merrill Lynch | 685 |
| 200 | Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 457 | (7) | Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT) | Goldman Sachs | 100 |
| | | Bank of America | | | | Morgan Stanley | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|--|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (1.500) | Mitsui High-Tec Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.775) | (600) | Musashino Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 331 |
| (300) | Mitsui High-Tec Inc | Goldman Sachs | (1.755) | (300) | Musashino Bank Ltd | Goldman Sachs | 138 |
| (300) | Mitsui OSK Lines Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (146) | (200) | Nachi-Fujikoshi Corp | Bank of America Merrill Lynch | 157 |
| 300 | Mitsui-Soko Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (428) | (400) | Nachi-Fujikoshi Corp | Goldman Sachs | 314 |
| (1.400) | Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 819 | (600) | Nafco Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 522 |
| (1.200) | Miura Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.339 | (300) | Nafco Co Ltd | Goldman Sachs | 261 |
| (600) | Miura Co Ltd | Goldman Sachs | 1.669 | (800) | Nagase & Co Ltd | Goldman Sachs | 514 |
| (1.000) | Miura Co Ltd | Morgan Stanley | 1.320 | (200) | Nagase & Co Ltd | Morgan Stanley | 131 |
| 300 | MIXI Inc | Bank of America Merrill Lynch | (434) | 1.900 | Nakanishi Inc | Bank of America Merrill Lynch | (190) |
| 1.100 | MIXI Inc | Goldman Sachs | (1.593) | 1.800 | Nakanishi Inc | Goldman Sachs | (180) |
| 3.400 | Mizuho Financial Group Inc | Morgan Stanley | (206) | (100) | Nankai Electric Railway Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 103 |
| 200 | Mizuho Leasing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (86) | (200) | Nankai Electric Railway Co Ltd | Morgan Stanley | 207 |
| 700 | Mizuho Leasing Co Ltd | Goldman Sachs | (300) | (900) | Nanto Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 336 |
| 200 | Mizuno Corp | Bank of America Merrill Lynch | (36) | (1.200) | Nanto Bank Ltd | Goldman Sachs | 339 |
| 500 | Mizuno Corp | Goldman Sachs | (143) | 6.200 | NEC Networks & System Integration Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.592 |
| 300 | Mochida Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (642) | 5.400 | NEC Networks & System Integration Corp | Goldman Sachs | 1.387 |
| 100 | Mochida Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | (214) | 5.100 | NEC Networks & System Integration Corp | Morgan Stanley | (146) |
| 200 | Modec Inc | Bank of America Merrill Lynch | (93) | 100 | NET One Systems Co Ltd | Goldman Sachs | (57) |
| 200 | Modec Inc | Goldman Sachs | (61) | 500 | NET One Systems Co Ltd | Morgan Stanley | (464) |
| (1.700) | Money Forward Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.396) | 200 | Nexon Co Ltd | Goldman Sachs | (234) |
| (500) | Money Forward Inc | Morgan Stanley | (178) | (500) | Nextage Co Ltd | Goldman Sachs | (328) |
| 1.000 | Monogatari Corp | Bank of America Merrill Lynch | 357 | (500) | Nextage Co Ltd | Morgan Stanley | (232) |
| 900 | Monogatari Corp | Goldman Sachs | 321 | 2.000 | NGK Insulators Ltd | Morgan Stanley | (1.099) |
| (2.200) | MonotaRO Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 722 | (7.900) | NHK Spring Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.100 |
| (800) | MonotaRO Co Ltd | Goldman Sachs | 263 | (6.100) | NHK Spring Co Ltd | Goldman Sachs | 2.394 |
| (1.300) | MonotaRO Co Ltd | Morgan Stanley | 594 | (7.900) | NHK Spring Co Ltd | Morgan Stanley | 3.664 |
| (33) | Mori Hills Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (400) | 1.100 | Nichias Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.405) |
| (3) | Mori Hills Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (36) | 700 | Nichias Corp | Goldman Sachs | (894) |
| (3) | Mori Hills Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | (116) | 2.200 | Nichicon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (439) |
| (1) | Mori Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (4) | 2.500 | Nichicon Corp | Goldman Sachs | (464) |
| (8) | Mori Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (81) | 300 | Nichiha Corp | Bank of America Merrill Lynch | (203) |
| (1.100) | Morinaga & Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 196 | 400 | Nichiha Corp | Goldman Sachs | (271) |
| (900) | Morinaga & Co Ltd | Goldman Sachs | 161 | (100) | NIDEC Corp | Bank of America Merrill Lynch | 237 |
| (2.300) | Morinaga & Co Ltd | Morgan Stanley | (1.231) | (500) | NIDEC Corp | Goldman Sachs | 137 |
| (200) | Morinaga Milk Industry Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 535 | (900) | Nifco Inc | Bank of America Merrill Lynch | 517 |
| (200) | Morinaga Milk Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 535 | (500) | Nifco Inc | Goldman Sachs | 931 |
| 200 | Morita Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (200) | (500) | Nifco Inc | Morgan Stanley | 1.052 |
| 1.500 | Morita Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.498) | (800) | Nihon Kohden Corp | Bank of America Merrill Lynch | 942 |
| 1.800 | MOS Food Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.477) | (200) | Nihon Kohden Corp | Goldman Sachs | 235 |
| 2.200 | MOS Food Services Inc | Goldman Sachs | (1.805) | (1.700) | Nihon Kohden Corp | Morgan Stanley | 2.244 |
| 200 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 247 | 3.200 | Nihon M&A Center Holdings Inc | Goldman Sachs | (845) |
| 2.400 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | Morgan Stanley | 68 | 2.800 | Nihon M&A Center Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.798) |
| (2.100) | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.438 | (500) | Nihon Parkerizing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 186 |
| (3.300) | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 2.260 | (600) | Nihon Parkerizing Co Ltd | Goldman Sachs | 223 |
| | | | | (700) | Nikkiso Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 410 |
| | | | | (1.000) | Nikkiso Co Ltd | Goldman Sachs | 585 |
| | | | | (300) | Nikkon Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 272 |
| | | | | (500) | Nikkon Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 453 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|------------------------------------|----------------------------------|---|--------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 2.100 | Nikon Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.259 | 600 | Nippon Soda Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (257) |
| 6.900 | Nikon Corp | Goldman Sachs | 4.135 | 500 | Nippon Soda Co Ltd | Goldman Sachs | (214) |
| 1.900 | Nikon Corp | Morgan Stanley | (203) | 600 | Nippon Steel Corp | Bank of America Merrill Lynch | (614) |
| (600) | Nippon Corp | Bank of America Merrill Lynch | 261 | 1.200 | Nippon Steel Corp | Goldman Sachs | (1.184) |
| (1.100) | Nippon Corp | Goldman Sachs | 479 | 300 | Nippon Steel Corp | Morgan Stanley | (320) |
| (24) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.418) | 100 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Bank of America Merrill Lynch | (174) |
| (18) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.027) | 300 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Goldman Sachs | (522) |
| (13) | Nippon Building Fund Inc (REIT) | Morgan Stanley | (812) | 100 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | Morgan Stanley | (178) |
| (900) | Nippon Carbon Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 321 | 600 | Nippon Television Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 77 |
| (1.200) | Nippon Carbon Co Ltd | Goldman Sachs | 428 | 700 | Nippon Television Holdings Inc | Goldman Sachs | 90 |
| 400 | Nippon Ceramic Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (499) | (800) | Nippon Yusen KK | Morgan Stanley | 340 |
| 1.000 | Nippon Ceramic Co Ltd | Goldman Sachs | (1.249) | 1.500 | Nipro Corp | Bank of America Merrill Lynch | (139) |
| 100 | Nippon Densetsu Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | (92) | 3.100 | Nipro Corp | Goldman Sachs | (288) |
| (2.300) | Nippon Electric Glass Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (476) | (100) | Nishimatsu Construction Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 25 |
| (1.100) | Nippon Electric Glass Co Ltd | Goldman Sachs | (228) | (300) | Nishimatsu Construction Co Ltd | Goldman Sachs | 16 |
| (3.600) | Nippon Electric Glass Co Ltd | Morgan Stanley | (51) | (2.000) | Nishimatsuya Chain Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 485 |
| 200 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | Goldman Sachs | (371) | (1.800) | Nishimatsuya Chain Co Ltd | Goldman Sachs | 437 |
| 100 | NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc | Morgan Stanley | (371) | 3.500 | Nishi-Nippon Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.005) |
| 4.300 | Nippon Gas Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.252) | 1.600 | Nishi-Nippon Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | (450) |
| 1.200 | Nippon Gas Co Ltd | Goldman Sachs | (908) | (1.900) | Nishi-Nippon Railroad Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.115 |
| 13 | NIPPON Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (430) | (700) | Nishio Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 363 |
| 11 | NIPPON Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (384) | (200) | Nishio Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 78 |
| (8.200) | Nippon Kayaku Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 5.616 | 17.600 | Nissan Motor Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.268 |
| (2.700) | Nippon Kayaku Co Ltd | Morgan Stanley | 1.425 | 3.600 | Nissan Motor Co Ltd | Goldman Sachs | 64 |
| 2.400 | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.479) | 2.500 | Nissan Motor Co Ltd | Morgan Stanley | 11 |
| 2.900 | Nippon Light Metal Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (1.714) | 2.200 | Nissan Shatai Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.114) |
| 3.000 | Nippon Paper Industries Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 892 | 300 | Nissan Shatai Co Ltd | Goldman Sachs | (152) |
| 1.500 | Nippon Paper Industries Co Ltd | Goldman Sachs | 503 | (1.300) | Nissha Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 649 |
| 3.700 | Nippon Parking Development Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (317) | (1.100) | Nissha Co Ltd | Goldman Sachs | 549 |
| 6.300 | Nippon Parking Development Co Ltd | Goldman Sachs | (539) | 400 | Nisshin Oillio Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (518) |
| (200) | Nippon Road Co Ltd | Goldman Sachs | (300) | 600 | Nisshin Oillio Group Ltd | Goldman Sachs | (812) |
| (1.800) | Nippon Sanso Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (873) | (3.800) | Nisshin Seifun Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 434 |
| (500) | Nippon Sanso Holdings Corp | Goldman Sachs | (243) | (500) | Nisshin Seifun Group Inc | Goldman Sachs | 57 |
| (1.500) | Nippon Sanso Holdings Corp | Morgan Stanley | 589 | (2.000) | Nisshin Seifun Group Inc | Morgan Stanley | 899 |
| 2.000 | Nippon Seiki Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (947) | 3.500 | Nisshinbo Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.198) |
| 1.700 | Nippon Seiki Co Ltd | Goldman Sachs | (1.044) | 3.200 | Nisshinbo Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.117) |
| 200 | Nippon Shinyaku Co Ltd | Morgan Stanley | (71) | 4.100 | Nissui Corp | Bank of America Merrill Lynch | (59) |
| (500) | Nippon Shokubai Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 321 | 5.800 | Nissui Corp | Goldman Sachs | (83) |
| (300) | Nippon Shokubai Co Ltd | Goldman Sachs | 193 | 100 | Niterra Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 14 |
| (300) | Nippon Signal Company Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 66 | 2.000 | Niterra Co Ltd | Goldman Sachs | 271 |
| (500) | Nippon Signal Company Ltd | Goldman Sachs | 111 | 1.300 | Niterra Co Ltd | Morgan Stanley | (584) |
| | | | | (200) | Nitori Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 2.690 |
| | | | | (100) | Nitori Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 1.345 |
| | | | | (100) | Nitori Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 1.024 |
| | | | | 100 | Nittetsu Mining Co Ltd | Goldman Sachs | (43) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------------------------|---|--------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1.100 | Nitto Boseki Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4.199 | (36) | NTT UD Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 344 |
| 1.100 | Nitto Boseki Co Ltd | Goldman Sachs | 4.199 | (37) | NTT UD Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 256 |
| 200 | Nitto Denko Corp | Bank of America Merrill Lynch | 771 | 300 | Obara Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (151) |
| 100 | Nitto Denko Corp | Goldman Sachs | 385 | 1.200 | Obara Group Inc | Goldman Sachs | 615 |
| 300 | Nitto Kogyo Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.244 | 13.100 | Obayashi Corp | Morgan Stanley | (2.897) |
| 100 | Nitto Kogyo Corp | Goldman Sachs | 415 | 500 | OBIC Business Consultants Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (499) |
| (400) | Noevir Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 542 | 1.100 | OBIC Business Consultants Co Ltd | Goldman Sachs | (1.099) |
| (500) | Noevir Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 999 | 1.000 | OBIC Business Consultants Co Ltd | Morgan Stanley | (2.568) |
| (600) | NOF Corp | Morgan Stanley | 771 | (600) | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 295 |
| 200 | Nohmi Bosai Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (157) | (1.100) | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Goldman Sachs | 541 |
| 300 | Nohmi Bosai Ltd | Goldman Sachs | (235) | (600) | Odakyu Electric Railway Co Ltd | Morgan Stanley | 604 |
| (1.600) | Nojima Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.769 | (1.300) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 751 |
| (1.200) | Nojima Corp | Goldman Sachs | 1.208 | (2.500) | Ogaki Kyoritsu Bank Ltd | Goldman Sachs | 1.376 |
| (300) | NOK Corp | Bank of America Merrill Lynch | (34) | 200 | Ohsho Food Service Corp | Bank of America Merrill Lynch | 71 |
| (1.000) | NOK Corp | Goldman Sachs | (114) | 200 | Ohsho Food Service Corp | Goldman Sachs | 71 |
| 700 | Nomura Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (54) | 1.200 | Oiles Corp | Bank of America Merrill Lynch | 26 |
| 2.700 | Nomura Co Ltd | Goldman Sachs | (193) | (300) | Oisix ra daichi Inc | Bank of America Merrill Lynch | 32 |
| (2.500) | Nomura Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 143 | (1.800) | Oisix ra daichi Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.363 |
| (12.300) | Nomura Holdings Inc | Goldman Sachs | 702 | 200 | Okamura Corp | Bank of America Merrill Lynch | (59) |
| (5.200) | Nomura Holdings Inc | Morgan Stanley | 475 | 600 | Okamura Corp | Goldman Sachs | (68) |
| (3) | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (32) | (2.800) | Okasan Securities Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (180) |
| (3) | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | Morgan Stanley | (13) | (7.500) | Okasan Securities Group Inc | Goldman Sachs | (367) |
| 600 | Nomura Research Institute Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (107) | 600 | Oki Electric Industry Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2) |
| 700 | Nomura Research Institute Ltd | Goldman Sachs | (125) | 5.700 | Oki Electric Industry Co Ltd | Goldman Sachs | 1.215 |
| 1.300 | Nomura Research Institute Ltd | Morgan Stanley | (1.391) | 300 | Okinawa Cellular Telephone Co | Bank of America Merrill Lynch | (203) |
| 600 | Noritsu Koki Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (381) | 700 | Okinawa Cellular Telephone Co | Goldman Sachs | (474) |
| 500 | Noritsu Koki Co Ltd | Goldman Sachs | (317) | 2.100 | Okinawa Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 150 |
| (200) | Noritz Corp | Bank of America Merrill Lynch | 117 | 2.100 | Okinawa Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | 150 |
| (500) | Noritz Corp | Goldman Sachs | 293 | (1.100) | Okinawa Financial Group Inc | Goldman Sachs | 534 |
| (900) | North Pacific Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 212 | (800) | OKUMA Corp | Goldman Sachs | (2.797) |
| (2.200) | North Pacific Bank Ltd | Goldman Sachs | 518 | (600) | OKUMA Corp | Morgan Stanley | (1.156) |
| 500 | NS Solutions Corp | Bank of America Merrill Lynch | 214 | 900 | Okumura Corp | Bank of America Merrill Lynch | 648 |
| 200 | NS Solutions Corp | Goldman Sachs | 86 | 900 | Okumura Corp | Goldman Sachs | 545 |
| 400 | NS Solutions Corp | Morgan Stanley | (171) | 1.000 | Olympus Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.109) |
| (500) | NS United Kaiun Kaisha Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 686 | 4.000 | Olympus Corp | Goldman Sachs | (4.438) |
| (1.700) | NS United Kaiun Kaisha Ltd | Goldman Sachs | 2.493 | 100 | Omron Corp | Bank of America Merrill Lynch | 174 |
| 700 | NSD Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 75 | 1.000 | Omron Corp | Morgan Stanley | (656) |
| 1.300 | NSD Co Ltd | Goldman Sachs | 158 | (6) | One Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (120) |
| 12.000 | NSK Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.082) | (10) | One Inc (REIT) | Goldman Sachs | (291) |
| 6.900 | NSK Ltd | Goldman Sachs | (1.772) | 400 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 98 |
| 14.700 | NSK Ltd | Morgan Stanley | (1.888) | 100 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | (25) |
| 10.100 | NTN Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.081) | | | | |
| 6.200 | NTN Corp | Goldman Sachs | (640) | | | | |
| (500) | NTT Data Corp | Bank of America Merrill Lynch | (275) | | | | |
| (1.900) | NTT Data Corp | Goldman Sachs | (1.044) | | | | |
| (800) | NTT Data Corp | Morgan Stanley | (80) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|-------------------------------|---|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (600) | Open Door Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.271 | (100) | Paramount Bed Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 145 |
| (1.600) | Open Door Inc | Goldman Sachs | 3.390 | (400) | Paramount Bed Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 579 |
| (100) | Open House Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 257 | (1.700) | Park24 Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.128 |
| (700) | Open House Group Co Ltd | Goldman Sachs | 1.798 | (500) | Park24 Co Ltd | Goldman Sachs | 332 |
| (600) | Open House Group Co Ltd | Morgan Stanley | 813 | (2.600) | Park24 Co Ltd | Morgan Stanley | 2.189 |
| 500 | Open Up Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (250) | 900 | Pasona Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (783) |
| 400 | Open Up Group Inc | Goldman Sachs | (200) | 600 | Pasona Group Inc | Goldman Sachs | (522) |
| 300 | Optex Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 21 | (600) | PeptiDream Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.485) |
| 300 | Optex Group Co Ltd | Goldman Sachs | 21 | (600) | PeptiDream Inc | Goldman Sachs | (1.485) |
| (400) | Optorun Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (354) | (1.000) | PeptiDream Inc | Morgan Stanley | (977) |
| (400) | Optorun Co Ltd | Goldman Sachs | (354) | (800) | Persol Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.347 |
| 100 | Oracle Corp Japan | Bank of America Merrill Lynch | 29 | (700) | Persol Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 1.179 |
| 100 | Oracle Corp Japan | Goldman Sachs | 29 | (2.000) | Persol Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 4.509 |
| 200 | Oracle Corp Japan | Morgan Stanley | 114 | (1.600) | Pharma Foods International Co Ltd | Goldman Sachs | 331 |
| (400) | Organo Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.070) | 500 | PHC Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 314 |
| (1.300) | Organo Corp | Goldman Sachs | (3.478) | 600 | PHC Holdings Corp | Goldman Sachs | 377 |
| (500) | ORIX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 14 | 600 | Pigeon Corp | Goldman Sachs | (946) |
| (500) | ORIX Corp | Morgan Stanley | 25 | 200 | Pigeon Corp | Morgan Stanley | (223) |
| (8) | Orix JREIT Inc (REIT) | Goldman Sachs | (439) | (500) | Pilot Corp | Goldman Sachs | 856 |
| (1.900) | Osaka Gas Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.179 | (800) | Piolax Inc | Bank of America Merrill Lynch | 285 |
| (2.200) | Osaka Gas Co Ltd | Goldman Sachs | 1.366 | (700) | Piolax Inc | Goldman Sachs | 253 |
| (1.500) | Osaka Gas Co Ltd | Morgan Stanley | 813 | (300) | PKSHA Technology Inc | Goldman Sachs | (1.550) |
| 500 | Osaka Organic Chemical Industry Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 985 | 300 | Plus Alpha Consulting Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 543 |
| 900 | Osaka Organic Chemical Industry Ltd | Goldman Sachs | 1.772 | 600 | Plus Alpha Consulting Co Ltd | Goldman Sachs | 1.151 |
| (200) | Osaka Soda Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (140) | 2.300 | Pola Orbis Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.888) |
| (900) | Osaka Soda Co Ltd | Goldman Sachs | (738) | 2.100 | Pola Orbis Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.637) |
| (700) | OSAKA Titanium Technologies Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.373 | 8.500 | Pola Orbis Holdings Inc | Morgan Stanley | (11.340) |
| (800) | OSAKA Titanium Technologies Co Ltd | Goldman Sachs | 1.570 | 100 | Pressance Corp | Goldman Sachs | (158) |
| (800) | OSG Corp | Bank of America Merrill Lynch | 234 | 1.100 | Prestige International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 126 |
| (800) | OSG Corp | Goldman Sachs | 234 | 9.400 | Prestige International Inc | Goldman Sachs | 1.073 |
| 2.900 | Otsuka Corp | Morgan Stanley | (1.448) | (300) | Prima Meat Packers Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 338 |
| 200 | Otsuka Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 422 | (100) | Prima Meat Packers Ltd | Goldman Sachs | 113 |
| 400 | Otsuka Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 845 | 2.100 | Raito Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.229) |
| 500 | Otsuka Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 303 | 1.400 | Raito Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | (819) |
| 1.600 | Outsourcing Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.009) | (200) | Raiznext Corp | Bank of America Merrill Lynch | 173 |
| 3.300 | Outsourcing Inc | Goldman Sachs | (4.144) | (200) | Raiznext Corp | Goldman Sachs | 173 |
| (700) | Pacific Industrial Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 320 | (600) | Rakusul Inc | Goldman Sachs | 257 |
| (1.200) | Pacific Industrial Co Ltd | Goldman Sachs | 548 | (1.000) | Rakus Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 43 |
| 500 | Pacific Metals Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (239) | (2.200) | Rakus Co Ltd | Goldman Sachs | 94 |
| (200) | PAL GROUP Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 36 | (1.900) | Rakus Co Ltd | Morgan Stanley | 596 |
| (500) | PAL GROUP Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 89 | 500 | Rakuten Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (129) |
| (100) | PALTAC Corp | Bank of America Merrill Lynch | 89 | 2.600 | Recruit Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 7.680 |
| (200) | PALTAC Corp | Goldman Sachs | 178 | 2.300 | Recruit Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 6.793 |
| (900) | Pan Pacific International Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.477 | 900 | Recruit Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (796) |
| (2.300) | Pan Pacific International Holdings Corp | Goldman Sachs | 3.774 | (1.700) | Relo Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 728 |
| (2.400) | Pan Pacific International Holdings Corp | Morgan Stanley | 4.966 | (1.300) | Relo Group Inc | Goldman Sachs | 556 |
| | | | | (900) | Relo Group Inc | Morgan Stanley | 732 |
| | | | | (2.500) | Rengo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.195 |
| | | | | (1.200) | Rengo Co Ltd | Goldman Sachs | 574 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-----------------------------|-----------------|---|--------------------------|--|-----------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (2.100) | Rengo Co Ltd | Morgan Stanley | 330 | (1.000) | SAMTY Co Ltd | Bank of America | |
| 500 | Resona Holdings Inc | Goldman Sachs | 16 | | | Merrill Lynch | 528 |
| (1.700) | Resonac Holdings Corp | Bank of America | | (1.500) | SAMTY Co Ltd | Goldman Sachs | 792 |
| | | Merrill Lynch | 594 | (22) | Samty Residential Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| (3.800) | Resonac Holdings Corp | Goldman Sachs | 1.328 | | | Merrill Lynch | (364) |
| (3.600) | Resonac Holdings Corp | Morgan Stanley | (257) | (14) | Samty Residential Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (232) |
| 500 | Resorttrust Inc | Bank of America | | (200) | SanBio Co Ltd | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (853) | | | Merrill Lynch | (70) |
| 200 | Resorttrust Inc | Goldman Sachs | (341) | (500) | Sangetsu Corp | Bank of America | |
| (1.400) | Retail Partners Co Ltd | Merrill Lynch | 459 | | | Merrill Lynch | 453 |
| | | Goldman Sachs | 33 | (300) | Sangetsu Corp | Goldman Sachs | 272 |
| (100) | Retail Partners Co Ltd | Bank of America | | 200 | San-In Godo Bank Ltd | Bank of America | |
| 8.300 | Ricoh Co Ltd | Merrill Lynch | 6.751 | | | Merrill Lynch | (16) |
| | | Goldman Sachs | 3.335 | 300 | Sanken Electric Co Ltd | Goldman Sachs | 1.177 |
| 4.100 | Ricoh Co Ltd | Morgan Stanley | — | (500) | Sanki Engineering Co Ltd | Bank of America | |
| 9.500 | Ricoh Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 243 |
| 400 | Ricoh Leasing Co Ltd | Merrill Lynch | (699) | (1.100) | Sanki Engineering Co Ltd | Goldman Sachs | 534 |
| | | Goldman Sachs | (699) | 700 | Sanrio Co Ltd | Bank of America | |
| 400 | Ricoh Leasing Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.748) |
| (200) | Riken Keiki Co Ltd | Merrill Lynch | 50 | 600 | Sanrio Co Ltd | Goldman Sachs | (1.498) |
| | | Goldman Sachs | 200 | 300 | Sanrio Co Ltd | Morgan Stanley | (1.156) |
| (800) | Riken Keiki Co Ltd | Bank of America | | (100) | Sansan Inc | Bank of America | |
| (1.000) | Ringer Hut Co Ltd | Merrill Lynch | 385 | | | Merrill Lynch | (6) |
| | | Goldman Sachs | 347 | (1.100) | Sansan Inc | Goldman Sachs | (63) |
| (900) | Ringer Hut Co Ltd | Bank of America | | 2.700 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 655 |
| (700) | Riso Kagaku Corp | Merrill Lynch | 929 | | | | |
| | | Bank of America | | 3.100 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | (840) |
| 800 | Riso Kyoiku Co Ltd | Merrill Lynch | 97 | (2.100) | Sanwa Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.244) |
| | | Goldman Sachs | 291 | (2.800) | Sanwa Holdings Corp | Morgan Stanley | (300) |
| 2.400 | Riso Kyoiku Co Ltd | Bank of America | | (200) | Sanyo Denki Co Ltd | Bank of America | |
| 300 | Rohm Co Ltd | Merrill Lynch | 1.969 | | | Merrill Lynch | (556) |
| | | Goldman Sachs | 1.313 | (300) | Sanyo Denki Co Ltd | Goldman Sachs | (835) |
| 200 | Rohm Co Ltd | Morgan Stanley | (278) | 300 | Sapporo Holdings Ltd | Bank of America | |
| 300 | Rohm Co Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (460) |
| (1.800) | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | Merrill Lynch | 642 | 200 | Sapporo Holdings Ltd | Goldman Sachs | (307) |
| | | Goldman Sachs | 428 | 200 | Sapporo Holdings Ltd | Morgan Stanley | (328) |
| (1.200) | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | | | 800 | Sato Holdings Corp | Goldman Sachs | (2.568) |
| (1.600) | Rohto Pharmaceutical Co Ltd | Morgan Stanley | 2.112 | 800 | Sawai Group Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.312) |
| (400) | Roland Corp | Merrill Lynch | 571 | 1.000 | Sawai Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (2.889) |
| | | Goldman Sachs | 428 | 500 | Sawai Group Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (1.516) |
| (300) | Roland Corp | Bank of America | | (500) | SB Technology Corp | Bank of America | |
| (600) | Rorze Corp | Merrill Lynch | (4.966) | | | Merrill Lynch | 139 |
| | | Goldman Sachs | (5.793) | (100) | SB Technology Corp | Goldman Sachs | 28 |
| (700) | Rorze Corp | Bank of America | | (4.800) | SBI Shinsei Bank Ltd | Goldman Sachs | (103) |
| 2.500 | Round One Corp | Merrill Lynch | 392 | (500) | SBS Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | 518 | | | Merrill Lynch | 767 |
| 3.300 | Round One Corp | Bank of America | | (800) | SBS Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.227 |
| 300 | Royal Holdings Co Ltd | Merrill Lynch | (303) | (100) | SCREEN Holdings Co Ltd | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | (563) | | | Merrill Lynch | (1.998) |
| 500 | Royal Holdings Co Ltd | Bank of America | | (100) | SCREEN Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (1.998) |
| 100 | RS Technologies Co Ltd | Merrill Lynch | 181 | 400 | SCSK Corp | Bank of America | |
| | | Morgan Stanley | (2.397) | | | Merrill Lynch | 88 |
| 2.400 | Ryohin Keikaku Co Ltd | Bank of America | | 200 | SCSK Corp | Goldman Sachs | 44 |
| (500) | Ryoyo Electro Corp | Merrill Lynch | (400) | 200 | SCSK Corp | Morgan Stanley | (78) |
| | | Goldman Sachs | (160) | (300) | Secom Co Ltd | Bank of America | |
| (200) | Ryoyo Electro Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 210 |
| (2.100) | Saibu Gas Holdings Co Ltd | Merrill Lynch | (30) | (200) | Secom Co Ltd | Goldman Sachs | 140 |
| | | Goldman Sachs | (6) | (100) | Secom Co Ltd | Morgan Stanley | 220 |
| (400) | Saibu Gas Holdings Co Ltd | Bank of America | | 300 | Sega Sammy Holdings Inc | Goldman Sachs | (40) |
| 1.000 | Saizeriya Co Ltd | Merrill Lynch | (413) | 200 | Sega Sammy Holdings Inc | Morgan Stanley | (129) |
| | | Goldman Sachs | (263) | 1.600 | Seiko Epson Corp | Bank of America | |
| 700 | Saizeriya Co Ltd | | | | | Merrill Lynch | 571 |
| 600 | Sakai Moving Service Co Ltd | Goldman Sachs | (1.370) | 900 | Seiko Epson Corp | Goldman Sachs | 321 |
| | | Bank of America | | 1.900 | Seiko Epson Corp | Morgan Stanley | (474) |
| 100 | Sakata INX Corp | Merrill Lynch | (42) | (1.200) | Seiko Group Corp | Bank of America | |
| | | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 71 |
| 800 | Sakata Seed Corp | Merrill Lynch | (913) | | | | |
| | | Goldman Sachs | (1.484) | | | | |
| 1.300 | Sakata Seed Corp | | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|---|----------------------------------|---|--------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (300) | Seiko Group Corp | Goldman Sachs | (10) | 300 | Shionogi & Co Ltd | Morgan Stanley | (163) |
| (800) | Seino Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (388) | (1.500) | Shizuoka Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 214 |
| 1.600 | Seiren Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (879) | 200 | Shizuoka Gas Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (26) |
| 2.000 | Seiren Co Ltd | Goldman Sachs | (1.099) | 200 | Shizuoka Gas Co Ltd | Goldman Sachs | (26) |
| (300) | Sekisui Chemical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2) | (200) | Shochiku Co Ltd | Goldman Sachs | 1.099 |
| (500) | Sekisui Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | (4) | (300) | Shochiku Co Ltd | Morgan Stanley | 1.156 |
| (300) | Sekisui Chemical Co Ltd | Morgan Stanley | 182 | 900 | Shoei Co Ltd | Goldman Sachs | (64) |
| (43) | Sekisui House Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 31 | (200) | Shoei Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | 100 |
| (54) | Sekisui House Inc (REIT) | Goldman Sachs | 39 | (100) | Shoei Foods Corp | Goldman Sachs | 50 |
| (36) | Sekisui House Inc (REIT) | Morgan Stanley | 283 | (700) | Showa Sangyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 330 |
| (200) | Sekisui Jushi Corp | Bank of America Merrill Lynch | 213 | (500) | Showa Sangyo Co Ltd | Goldman Sachs | 235 |
| (300) | Sekisui Jushi Corp | Goldman Sachs | 319 | (700) | Simplex Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 70 |
| (2.300) | Senko Group Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 591 | (1.000) | Simplex Holdings Inc | Goldman Sachs | 100 |
| (2.900) | Senko Group Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 745 | (1.900) | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 488 |
| (300) | Septeni Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (4) | (1.100) | SKY Perfect JSAT Holdings Inc | Goldman Sachs | 283 |
| (200) | Seria Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 19 | 100 | Socionext Inc | Morgan Stanley | 1.617 |
| (1.400) | Seven & i Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 6.043 | (2.200) | SoftBank Corp | Bank of America Merrill Lynch | 683 |
| (1.800) | Seven Bank Ltd | Morgan Stanley | (39) | (3.000) | SoftBank Corp | Goldman Sachs | 931 |
| (1.600) | SG Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.006 | (2.900) | SoftBank Corp | Morgan Stanley | 552 |
| (2.300) | SG Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 1.531 | 2.100 | SoftBank Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | 7.866 |
| (1.900) | SG Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 1.753 | 1.800 | SoftBank Group Corp | Goldman Sachs | 6.742 |
| 600 | Sharp Corp | Bank of America Merrill Lynch | (325) | 3.700 | Sohgo Security Services Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (528) |
| 1.800 | Sharp Corp | Morgan Stanley | (822) | 500 | Sohgo Security Services Co Ltd | Goldman Sachs | (71) |
| 100 | Shibaura Machine Co Ltd | Goldman Sachs | 838 | 3.700 | Sohgo Security Services Co Ltd | Morgan Stanley | (1.716) |
| (400) | Shibuya Corp | Bank of America Merrill Lynch | 485 | (500) | Sojitz Corp | Morgan Stanley | 150 |
| (400) | Shibuya Corp | Goldman Sachs | 485 | 400 | Solasto Corp | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| (210) | SHIFT Inc | Goldman Sachs | 1.363 | 700 | Solasto Corp | Goldman Sachs | (225) |
| (500) | Shiga Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 114 | 2.600 | Sompo Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.931) |
| (1.500) | Shiga Bank Ltd | Goldman Sachs | 501 | 300 | Sompo Holdings Inc | Morgan Stanley | (693) |
| 100 | Shikoku Kasei Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 7 | (1.300) | Sony Group Corp | Morgan Stanley | 4.174 |
| (500) | Shima Seiki Manufacturing Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 257 | (200) | Sosei Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | (209) |
| (100) | Shima Seiki Manufacturing Ltd | Goldman Sachs | 51 | (4) | SOSiLA Logistics Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 21 |
| (100) | Shimano Inc | Goldman Sachs | (243) | (15) | SOSiLA Logistics Inc (REIT) | Goldman Sachs | 126 |
| (300) | Shimano Inc | Morgan Stanley | 225 | (600) | Sotetsu Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 800 |
| 2.200 | Shimizu Corp | Bank of America Merrill Lynch | (188) | (500) | Sotetsu Holdings Inc | Goldman Sachs | 667 |
| 5.900 | Shimizu Corp | Goldman Sachs | (505) | (900) | Sotetsu Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.175 |
| 5.200 | Shimizu Corp | Morgan Stanley | (1.298) | (400) | Sparx Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 54 |
| (1.900) | Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (163) | (200) | Sparx Group Co Ltd | Goldman Sachs | 27 |
| (200) | Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd | Goldman Sachs | (113) | 900 | S-Pool Inc | Bank of America Merrill Lynch | (315) |
| (1.800) | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | Morgan Stanley | (308) | 400 | S-Pool Inc | Goldman Sachs | (140) |
| 1.200 | Shin-Etsu Polymer Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 214 | (300) | Square Enix Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.092 |
| 2.200 | Shin-Etsu Polymer Co Ltd | Goldman Sachs | 392 | (300) | Square Enix Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 1.113 |
| (1.000) | Shinko Electric Industries Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (5.208) | (400) | SRE Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.042 |
| (800) | Shinko Electric Industries Co Ltd | Goldman Sachs | (4.167) | (1.000) | Stanley Electric Co Ltd | Morgan Stanley | 977 |
| 200 | Shinmaywa Industries Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (49) | 91 | Star Asia Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (99) |
| 300 | Shinmaywa Industries Ltd | Goldman Sachs | (70) | 67 | Star Asia Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (26) |
| 100 | Shionogi & Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 40 | (300) | Star Micronics Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 68 |
| 100 | Shionogi & Co Ltd | Goldman Sachs | 40 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|---|--------------------------|---|----------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| (100) | Star Micronics Co Ltd | Goldman Sachs | 23 | 4.100 | T&D Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.188 |
| 1.100 | Starts Corp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 164 | 3.900 | T&D Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.085) |
| 700 | Starts Corp Inc | Goldman Sachs | 119 | 1.900 | Tadano Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (462) |
| 1.300 | Strike Co Ltd | Goldman Sachs | (1.669) | 1.300 | Tadano Ltd | Goldman Sachs | (307) |
| 3.400 | Subaru Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.748 | (100) | Taihei Dengyo Kaisha Ltd | Goldman Sachs | 171 |
| 3.100 | Subaru Corp | Goldman Sachs | 3.417 | (3.400) | Taiheiyu Cement Corp | Morgan Stanley | 1.892 |
| 3.800 | Subaru Corp | Morgan Stanley | 1.437 | 200 | Taikisha Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (196) |
| 200 | Sugi Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 29 | 200 | Taikisha Ltd | Goldman Sachs | (285) |
| 400 | Sugi Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (942) | 1.700 | Taisei Corp | Goldman Sachs | (4.791) |
| (3.700) | SUMCO Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.722) | 100 | Taisei Corp | Morgan Stanley | (175) |
| (600) | SUMCO Corp | Goldman Sachs | (604) | 1.200 | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.339) |
| (500) | SUMCO Corp | Morgan Stanley | (164) | 900 | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (2.504) |
| 3.900 | Sumitomo Chemical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (974) | 400 | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (1.142) |
| 5.100 | Sumitomo Chemical Co Ltd | Goldman Sachs | (1.274) | 200 | Taiyo Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (56) |
| 1.600 | Sumitomo Chemical Co Ltd | Morgan Stanley | (137) | 400 | Taiyo Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (111) |
| (100) | Sumitomo Forestry Co Ltd | Goldman Sachs | (57) | (1.500) | Taiyo Yuden Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (3.906) |
| (300) | Sumitomo Forestry Co Ltd | Morgan Stanley | 43 | (1.200) | Taiyo Yuden Co Ltd | Goldman Sachs | (3.125) |
| (1.100) | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | Morgan Stanley | 1.381 | (700) | Taiyo Yuden Co Ltd | Morgan Stanley | (999) |
| 4.900 | Sumitomo Mitsui Construction Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.189) | 900 | Takamatsu Construction Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (501) |
| 7.100 | Sumitomo Mitsui Construction Co Ltd | Goldman Sachs | (1.722) | 700 | Takamatsu Construction Group Co Ltd | Goldman Sachs | (365) |
| (100) | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (12) | 700 | Takara Bio Inc | Bank of America Merrill Lynch | (25) |
| 400 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Goldman Sachs | (457) | 500 | Takara Bio Inc | Goldman Sachs | (18) |
| 1.300 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | Morgan Stanley | (2.560) | (7.900) | Takara Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.367 |
| (500) | Sumitomo Osaka Cement Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 357 | (3.000) | Takara Holdings Inc | Goldman Sachs | 899 |
| (400) | Sumitomo Osaka Cement Co Ltd | Goldman Sachs | 285 | (4.600) | Takara Holdings Inc | Morgan Stanley | 2.166 |
| 2.000 | Sumitomo Pharma Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.383) | (13) | Takara Leben Real Estate Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 72 |
| 600 | Sumitomo Pharma Co Ltd | Goldman Sachs | (715) | (22) | Takara Leben Real Estate Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 142 |
| 400 | Sumitomo Pharma Co Ltd | Morgan Stanley | (171) | 100 | Takara Standard Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (18) |
| 2.600 | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | Morgan Stanley | 2.226 | 800 | Takara Standard Co Ltd | Goldman Sachs | (138) |
| (1.000) | Sumitomo Rubber Industries Ltd | Goldman Sachs | 478 | (200) | Takasago International Corp | Bank of America Merrill Lynch | 148 |
| 700 | Sumitomo Warehouse Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (303) | (400) | Takasago Thermal Engineering Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 157 |
| 1.100 | Sumitomo Warehouse Co Ltd | Goldman Sachs | (476) | (400) | Takasago Thermal Engineering Co Ltd | Goldman Sachs | 157 |
| 1.000 | Sun Frontier Fudosan Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 136 | 200 | Takashimaya Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (55) |
| 1.400 | Sun Frontier Fudosan Co Ltd | Goldman Sachs | 190 | 1.000 | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 315 |
| 100 | Sundrug Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 78 | 300 | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | Goldman Sachs | 193 |
| 100 | Sundrug Co Ltd | Goldman Sachs | 78 | 2.700 | Takuma Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 39 |
| 200 | Sundrug Co Ltd | Morgan Stanley | (556) | 5.100 | Takuma Co Ltd | Goldman Sachs | 73 |
| (1.900) | Suruga Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (474) | (200) | Tama Home Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 635 |
| (3.900) | Suruga Bank Ltd | Goldman Sachs | (974) | (400) | Tama Home Co Ltd | Goldman Sachs | 1.270 |
| (100) | Suzuken Co Ltd | Goldman Sachs | 346 | 1.000 | Tamron Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (571) |
| (200) | Systemex Corp | Bank of America Merrill Lynch | 264 | 100 | Tamron Co Ltd | Goldman Sachs | (57) |
| (200) | Systemex Corp | Morgan Stanley | 763 | 1.000 | TBS Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 371 |
| 16.100 | Systema Corp | Bank of America Merrill Lynch | 197 | 1.600 | TBS Holdings Inc | Goldman Sachs | 594 |
| 22.500 | Systema Corp | Goldman Sachs | 270 | 1.100 | TBS Holdings Inc | Morgan Stanley | 353 |
| (1.400) | T Hasegawa Co Ltd | Goldman Sachs | 1.748 | (100) | TDK Corp | Bank of America Merrill Lynch | (332) |
| 900 | T&D Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 700 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 300 | TechMatrix Corp | Bank of America Merrill Lynch | 41 | (300) | Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc | Goldman Sachs | 27 |
| 300 | TechMatrix Corp | Goldman Sachs | 41 | 600 | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 5.008 |
| (900) | Tenma Corp | Goldman Sachs | 128 | 100 | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | 835 |
| 900 | Terumo Corp | Bank of America Merrill Lynch | 26 | 300 | Tokyo Seimitsu Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.734 |
| 700 | Terumo Corp | Goldman Sachs | 20 | 200 | Tokyo Seimitsu Co Ltd | Goldman Sachs | 1.156 |
| 2.700 | Terumo Corp | Morgan Stanley | 135 | (300) | Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd | Goldman Sachs | (26) |
| 1.000 | T-Gaia Corp | Bank of America Merrill Lynch | (150) | 4.400 | Tokyo Tatemono Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (973) |
| 800 | T-Gaia Corp | Goldman Sachs | (120) | 3.200 | Tokyo Tatemono Co Ltd | Goldman Sachs | (708) |
| 100 | THK Co Ltd | Goldman Sachs | (71) | 2.600 | Tokyo Tatemono Co Ltd | Morgan Stanley | (1.132) |
| (400) | Toa Corp | Bank of America Merrill Lynch | 785 | 500 | Tokyotokeiba Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (910) |
| (700) | Toa Corp | Goldman Sachs | 1.373 | 500 | Tokyotokeiba Co Ltd | Goldman Sachs | (910) |
| (1.000) | Toagosei Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 321 | 3.700 | Tokyu Construction Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.452) |
| (400) | Toagosei Co Ltd | Goldman Sachs | 128 | 5.300 | Tokyu Construction Co Ltd | Goldman Sachs | (2.080) |
| (100) | TOC Co Ltd | Goldman Sachs | 33 | (4.700) | Tokyu Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6.002 |
| 500 | Tocalo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 32 | (2.400) | Tokyu Corp | Goldman Sachs | 3.065 |
| 100 | Tocalo Co Ltd | Goldman Sachs | 6 | (2.800) | Tokyu Corp | Morgan Stanley | 3.316 |
| (500) | Toei Co Ltd | Goldman Sachs | 2.069 | (1.100) | Tokyu Fudosan Holdings Corp | Goldman Sachs | 78 |
| (15.600) | Toho Bank Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 286 | (2.000) | Tokyu Fudosan Holdings Corp | Morgan Stanley | 143 |
| (17.700) | Toho Bank Ltd | Goldman Sachs | 394 | 6 | Tokyu Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 141 |
| 500 | Toho Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (107) | 11 | Tokyu Inc (REIT) | Goldman Sachs | 259 |
| 800 | Toho Co Ltd | Goldman Sachs | (171) | (600) | TOMONY Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 60 |
| 800 | Toho Co Ltd | Morgan Stanley | (1.256) | (13.000) | TOMONY Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.314 |
| (500) | Toho Gas Co Ltd | Goldman Sachs | 474 | (3.800) | Tomy Co Ltd | Goldman Sachs | (624) |
| (500) | Toho Gas Co Ltd | Morgan Stanley | 521 | 200 | Topcon Corp | Bank of America Merrill Lynch | 234 |
| (1.200) | Toho Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.224 | 800 | Topcon Corp | Goldman Sachs | 936 |
| (1.500) | Toho Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 1.530 | (600) | TOPPAN Inc | Bank of America Merrill Lynch | (231) |
| (11.600) | Tokai Carbon Co Ltd | Morgan Stanley | 6.869 | (1.400) | TOPPAN Inc | Goldman Sachs | (539) |
| 300 | Tokai Corp | Bank of America Merrill Lynch | (304) | (500) | TOPPAN Inc | Morgan Stanley | 96 |
| 900 | Tokai Corp | Goldman Sachs | (912) | (800) | Topre Corp | Bank of America Merrill Lynch | 297 |
| (6.200) | TOKAI Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 723 | (1.100) | Topre Corp | Goldman Sachs | 408 |
| (3.100) | TOKAI Holdings Corp | Goldman Sachs | 325 | 5.100 | Toray Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (779) |
| 900 | Tokai Rika Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 83 | 7.800 | Toray Industries Inc | Goldman Sachs | (1.191) |
| 800 | Tokai Rika Co Ltd | Goldman Sachs | 74 | 6.000 | Toray Industries Inc | Morgan Stanley | (852) |
| (5.000) | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 392 | 1.900 | Toridoll Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.071 |
| (12.400) | Tokai Tokyo Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 973 | 1.600 | Toridoll Holdings Corp | Goldman Sachs | 902 |
| 100 | Token Corp | Bank of America Merrill Lynch | (414) | (100) | Torii Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 111 |
| 300 | Token Corp | Goldman Sachs | (1.241) | 600 | Tosei Corp | Bank of America Merrill Lynch | 231 |
| 400 | Tokio Marine Holdings Inc | Morgan Stanley | 342 | 2.600 | Tosei Corp | Goldman Sachs | 1.002 |
| (400) | Tokushu Tokai Paper Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (203) | 500 | Totetsu Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | (646) |
| (600) | Tokushu Tokai Paper Co Ltd | Goldman Sachs | (304) | 800 | TOTO Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (2.454) |
| (1.000) | Tokuyama Corp | Bank of America Merrill Lynch | 43 | 600 | TOTO Ltd | Goldman Sachs | (1.841) |
| (1.200) | Tokuyama Corp | Goldman Sachs | 51 | 400 | TOTO Ltd | Morgan Stanley | (1.042) |
| (30.200) | Tokyo Electric Power Co Holdings Inc | Morgan Stanley | (862) | 1.300 | Towa Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.391) |
| (700) | Tokyo Electron Device Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (10.288) | 700 | Towa Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | (749) |
| (300) | Tokyo Electron Device Ltd | Goldman Sachs | (4.409) | (1.400) | Toyo Construction Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 30 |
| (1.800) | Tokyo Gas Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 26 | (1.500) | Toyo Construction Co Ltd | Goldman Sachs | 32 |
| (3.500) | Tokyo Gas Co Ltd | Morgan Stanley | 649 | 500 | Toyo Ink SC Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (99) |
| (200) | Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 1.100 | Toyo Ink SC Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (110) | (700) | United Super Markets Holdings Inc | Goldman Sachs | 494 |
| (400) | Toyo Seikan Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | 29 | (2) | United Urban Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | 76 |
| (100) | Toyo Suisan Kaisha Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (178) | (7) | United Urban Investment Corp (REIT) | Morgan Stanley | 365 |
| (700) | Toyo Suisan Kaisha Ltd | Goldman Sachs | (1.249) | 300 | Universal Entertainment Corp | Bank of America Merrill Lynch | (625) |
| (600) | Toyo Tanso Co Ltd | Goldman Sachs | (1.498) | 600 | Universal Entertainment Corp | Goldman Sachs | (1.250) |
| (2.300) | Toyo Tire Corp | Bank of America Merrill Lynch | (443) | 100 | Usen-Next Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 138 |
| (2.700) | Toyo Tire Corp | Goldman Sachs | (520) | 200 | Usen-Next Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 183 |
| (1.100) | Toyobo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 220 | 1.300 | Ushio Inc | Bank of America Merrill Lynch | 37 |
| (1.600) | Toyobo Co Ltd | Goldman Sachs | 320 | 1.300 | Ushio Inc | Goldman Sachs | 37 |
| 500 | Toyota Industries Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.247 | 900 | Ushio Inc | Morgan Stanley | 90 |
| (200) | Toyota Tsusho Corp | Bank of America Merrill Lynch | (200) | 500 | UT Group Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 168 |
| (300) | Toyota Tsusho Corp | Goldman Sachs | (300) | 1.100 | UT Group Co Ltd | Goldman Sachs | 369 |
| (800) | Toyota Tsusho Corp | Morgan Stanley | 571 | 800 | Valor Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.107) |
| (500) | Transcosmos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 107 | 1.200 | Valor Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (1.661) |
| (500) | Transcosmos Inc | Goldman Sachs | 107 | 2.000 | ValueCommerce Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (14) |
| 1.100 | TRE Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (981) | 1.200 | ValueCommerce Co Ltd | Goldman Sachs | (9) |
| 1.300 | TRE Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.159) | 200 | Vector Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3) |
| 400 | Trend Micro Inc | Goldman Sachs | 856 | 500 | Vector Inc | Goldman Sachs | (7) |
| 100 | Trend Micro Inc | Morgan Stanley | 128 | 500 | Vision Inc | Bank of America Merrill Lynch | 44 |
| 700 | Tri Chemical Laboratories Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.293 | 300 | Vision Inc | Goldman Sachs | 11 |
| 500 | Tri Chemical Laboratories Inc | Goldman Sachs | 924 | (100) | Visional Inc | Bank of America Merrill Lynch | (121) |
| 1.700 | Trusco Nakayama Corp | Goldman Sachs | (2.317) | (400) | Visional Inc | Goldman Sachs | (485) |
| 2.400 | TS Tech Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.644) | (300) | Visional Inc | Morgan Stanley | 171 |
| 1.700 | TS Tech Co Ltd | Goldman Sachs | (1.164) | 2.700 | VT Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (790) |
| 1.500 | TS Tech Co Ltd | Morgan Stanley | (1.274) | 2.400 | VT Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (702) |
| 100 | Tsubakimoto Chain Co | Bank of America Merrill Lynch | (80) | (1.100) | Wacoal Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 541 |
| (600) | Tsuburaya Fields Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.772) | (1.100) | Wacoal Holdings Corp | Goldman Sachs | 541 |
| (1.500) | Tsuburaya Fields Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.430) | (900) | Wacom Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 90 |
| (100) | Tsugami Corp | Goldman Sachs | 29 | (2.600) | Wacom Co Ltd | Goldman Sachs | 260 |
| 200 | Tsumura & Co | Bank of America Merrill Lynch | 16 | 2.200 | Wakita & Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.373) |
| 500 | Tsumura & Co | Morgan Stanley | (210) | 1.700 | Wakita & Co Ltd | Goldman Sachs | (1.116) |
| 800 | Tsuruha Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.482 | (100) | Weathernews Inc | Bank of America Merrill Lynch | 87 |
| 700 | Tsuruha Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.046 | (300) | Weathernews Inc | Goldman Sachs | 421 |
| 2.400 | Tsuruha Holdings Inc | Morgan Stanley | (9.589) | 400 | Welcia Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 3 |
| (400) | TV Asahi Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (77) | 700 | Welcia Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | (1.134) |
| (400) | TV Asahi Holdings Corp | Goldman Sachs | (77) | (700) | West Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 764 |
| 400 | UACJ Corp | Goldman Sachs | (545) | (1.300) | West Japan Railway Co | Bank of America Merrill Lynch | 2.643 |
| 200 | UBE Corp | Bank of America Merrill Lynch | 23 | (100) | West Japan Railway Co | Goldman Sachs | 203 |
| 1.200 | UBE Corp | Goldman Sachs | 137 | (1.700) | West Japan Railway Co | Morgan Stanley | 4.621 |
| 1.200 | UBE Corp | Morgan Stanley | (111) | (1.900) | W-Scope Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.507 |
| 900 | Ulvac Inc | Goldman Sachs | 3.018 | 100 | Yakult Honsha Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (628) |
| 200 | Ulvac Inc | Morgan Stanley | 243 | 200 | Yakult Honsha Co Ltd | Goldman Sachs | (1.256) |
| (1.300) | Unicharm Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.261 | 100 | Yakult Honsha Co Ltd | Morgan Stanley | (492) |
| (900) | Unicharm Corp | Goldman Sachs | 873 | (700) | YAMABIKO Corp | Bank of America Merrill Lynch | (40) |
| (100) | Union Tool Co | Bank of America Merrill Lynch | 38 | (1.200) | YAMABIKO Corp | Goldman Sachs | (68) |
| 1.500 | United Arrows Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (278) | (700) | Yamada Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 125 |
| 1.300 | United Arrows Ltd | Goldman Sachs | (241) | (2.300) | Yamada Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 246 |
| (1.700) | United Super Markets Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.201 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------|-------------------------------|-------------------------------|---|--------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---|
| Japan Fortsetzung | | | | Japan Fortsetzung | | | |
| 300 | Yamaha Corp | Bank of America Merrill Lynch | 300 | (900) | Zojirushi Corp | Bank of America Merrill Lynch | 931 |
| 300 | Yamaha Corp | Goldman Sachs | 300 | (1.300) | Zojirushi Corp | Goldman Sachs | 1.345 |
| 500 | Yamaha Corp | Morgan Stanley | (535) | 2.300 | ZOZO Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.873) |
| 200 | Yamaha Motor Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (158) | 3.600 | ZOZO Inc | Goldman Sachs | (6.061) |
| 100 | Yamaha Motor Co Ltd | Goldman Sachs | (7) | 700 | ZOZO Inc | Morgan Stanley | (804) |
| (1.700) | YA-MAN Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 230 | 1.600 | Zuken Inc | Goldman Sachs | (799) |
| (2.200) | YA-MAN Ltd | Goldman Sachs | 206 | | | | (32.830) |
| (2.300) | Yamato Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.116) | Niederlande | | | |
| (600) | Yamato Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | (291) | 46 | Aalberts NV | Goldman Sachs | (144) |
| (1.700) | Yamato Holdings Co Ltd | Morgan Stanley | 473 | 1.666 | ABN AMRO Bank NV - CVA | Bank of America Merrill Lynch | (863) |
| 500 | Yamato Kogyo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (321) | 575 | ABN AMRO Bank NV - CVA | Goldman Sachs | (298) |
| 600 | Yamato Kogyo Co Ltd | Goldman Sachs | (385) | 3.174 | ABN AMRO Bank NV - CVA | Morgan Stanley | (3.830) |
| 100 | Yamato Kogyo Co Ltd | Morgan Stanley | (43) | 1.827 | Aegon NV | Bank of America Merrill Lynch | (107) |
| 800 | Yamazén Corp | Bank of America Merrill Lynch | (137) | 764 | Aegon NV | Goldman Sachs | (45) |
| 400 | Yamazén Corp | Goldman Sachs | (68) | 1.100 | Aegon NV | Morgan Stanley | (276) |
| 900 | Yaskawa Electric Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.220 | (303) | Akzo Nobel NV | Bank of America Merrill Lynch | 1.779 |
| 700 | Yaskawa Electric Corp | Goldman Sachs | 949 | (258) | Akzo Nobel NV | Goldman Sachs | 1.515 |
| 1.000 | Yaskawa Electric Corp | Morgan Stanley | 428 | (780) | Akzo Nobel NV | Morgan Stanley | 4.714 |
| 300 | Yellow Hat Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (163) | (81) | Alfen NV | Goldman Sachs | 877 |
| 1.000 | Yellow Hat Ltd | Goldman Sachs | (542) | (188) | Alfen NV | Morgan Stanley | (454) |
| 100 | Yodogawa Steel Works Ltd | Goldman Sachs | 1 | (80) | AMG Critical Materials NV | Bank of America Merrill Lynch | (419) |
| (200) | Yokogawa Bridge Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 27 | (217) | AMG Critical Materials NV | Goldman Sachs | (1.138) |
| (800) | Yokogawa Bridge Holdings Corp | Goldman Sachs | 108 | (364) | Arcadis NV | Bank of America Merrill Lynch | 832 |
| (1.000) | Yokogawa Electric Corp | Goldman Sachs | (1.320) | (533) | Arcadis NV | Goldman Sachs | 1.152 |
| (500) | Yokohama Rubber Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 182 | 1.049 | ArcelorMittal SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.221) |
| (2.300) | Yokohama Rubber Co Ltd | Goldman Sachs | 837 | 1.358 | ArcelorMittal SA | Morgan Stanley | (1.631) |
| (800) | Yokohama Rubber Co Ltd | Morgan Stanley | 925 | (65) | ASM International NV | Goldman Sachs | (4.681) |
| (1.000) | Yokorei Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 7 | (285) | ASM International NV | Morgan Stanley | (11.716) |
| (1.200) | Yokorei Co Ltd | Goldman Sachs | 9 | 2 | ASR Nederland NV ^{††} | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (600) | Yokowo Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 312 | 164 | ASR Nederland NV | Goldman Sachs | 30 |
| (1.200) | Yokowo Co Ltd | Goldman Sachs | 625 | 902 | ASR Nederland NV | Morgan Stanley | (944) |
| (200) | Yonex Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 181 | (300) | B&S Group Sarl | Bank of America Merrill Lynch | 99 |
| (400) | Yonex Co Ltd | Goldman Sachs | 362 | (480) | B&S Group Sarl | Goldman Sachs | 159 |
| (100) | Yoshinoya Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1 | 68 | Basic-Fit NV | Goldman Sachs | (176) |
| (1.500) | Yoshinoya Holdings Co Ltd | Goldman Sachs | 11 | (313) | Corbion NV | Bank of America Merrill Lynch | 1.143 |
| 300 | Yuasa Trading Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (342) | (147) | Corbion NV | Goldman Sachs | 435 |
| 400 | Yuasa Trading Co Ltd | Goldman Sachs | (457) | 196 | DSM-Firmenich AG | Morgan Stanley | (2.817) |
| 2.700 | Yurtec Corp | Goldman Sachs | (1.137) | (471) | Flow Traders Ltd | Goldman Sachs | 191 |
| (7.300) | Z Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 625 | (968) | Fugro NV | Bank of America Merrill Lynch | 517 |
| (18.200) | Z Holdings Corp | Goldman Sachs | 1.558 | (1.382) | Fugro NV | Goldman Sachs | 738 |
| (6.900) | Z Holdings Corp | Morgan Stanley | 601 | (293) | Galapagos NV | Bank of America Merrill Lynch | (12) |
| 2.400 | Zenrin Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.147) | (371) | Galapagos NV | Goldman Sachs | (16) |
| 1.500 | Zenrin Co Ltd | Goldman Sachs | (717) | (46) | Heineken NV | Bank of America Merrill Lynch | 522 |
| (200) | Zensho Holdings Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (785) | (419) | Heineken NV | Morgan Stanley | 3.409 |
| 700 | Zeon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (220) | (175) | ING Groep NV | Bank of America Merrill Lynch | 64 |
| 1.400 | Zeon Corp | Goldman Sachs | (439) | 544 | InPost SA | Bank of America Merrill Lynch | (52) |
| 1.500 | Zeon Corp | Morgan Stanley | (610) | 851 | InPost SA | Goldman Sachs | (82) |
| (300) | ZERIA Pharmaceutical Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 398 | (288) | JDE Peet's NV | Bank of America Merrill Lynch | 117 |
| (200) | ZERIA Pharmaceutical Co Ltd | Goldman Sachs | 265 | (87) | JDE Peet's NV | Goldman Sachs | 35 |
| | | | | (1.499) | JDE Peet's NV | Morgan Stanley | 544 |
| | | | | (1.343) | Just Eat Takeaway.com NV | Bank of America Merrill Lynch | 3.645 |
| | | | | (2.242) | Just Eat Takeaway.com NV | Morgan Stanley | 3.897 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|--------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|-------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Niederlande Fortsetzung | | | | Neuseeland Fortsetzung | | | |
| (486) | Koninklijke Ahold Delhaize NV | Morgan Stanley | 555 | (3.507) | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Morgan Stanley | 6.415 |
| 11.144 | Koninklijke KPN NV | Bank of America Merrill Lynch | (1.059) | 4.043 | Infratil Ltd | Goldman Sachs | 1.091 |
| 9.224 | Koninklijke KPN NV | Goldman Sachs | (876) | 4.911 | Infratil Ltd | Morgan Stanley | 1.605 |
| 1.992 | Koninklijke KPN NV | Morgan Stanley | (83) | (1.215) | Mainfreight Ltd | Goldman Sachs | 663 |
| (180) | Koninklijke Philips NV | Bank of America Merrill Lynch | 119 | (1.180) | Mainfreight Ltd | Morgan Stanley | 1.486 |
| 1.035 | Koninklijke Vopak NV | Bank of America Merrill Lynch | (1.249) | (2.991) | Mercury NZ Ltd | Morgan Stanley | (90) |
| 433 | Koninklijke Vopak NV | Goldman Sachs | (522) | (12.755) | Meridian Energy Ltd | Morgan Stanley | 765 |
| 242 | Koninklijke Vopak NV | Morgan Stanley | — | (1.262) | Spark New Zealand Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 46 |
| (105) | NSI NV (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 28 | (7.034) | Spark New Zealand Ltd | Goldman Sachs | 253 |
| (24) | NSI NV (REIT) | Goldman Sachs | 6 | (8.986) | Spark New Zealand Ltd | Morgan Stanley | 485 |
| (76) | OCI NV | Bank of America Merrill Lynch | 186 | | | | 20.044 |
| (348) | OCI NV | Morgan Stanley | 859 | Norwegen | | | |
| (768) | Pharming Group NV | Bank of America Merrill Lynch | 11 | (4.214) | Adevinta ASA | Bank of America Merrill Lynch | 132 |
| (1.509) | Pharming Group NV | Goldman Sachs | 28 | (3.096) | Adevinta ASA | Morgan Stanley | 611 |
| 7.725 | PostNL NV | Bank of America Merrill Lynch | (1.314) | (33) | Aker ASA 'A' | Morgan Stanley | 117 |
| 7.655 | PostNL NV | Goldman Sachs | (1.305) | 1.299 | Aker BP ASA | Bank of America Merrill Lynch | (803) |
| (303) | Prosus NV | Bank of America Merrill Lynch | 1.932 | 2.244 | Aker BP ASA | Goldman Sachs | (1.388) |
| (39) | Prosus NV | Goldman Sachs | 249 | 838 | Aker BP ASA | Morgan Stanley | (473) |
| (179) | Prosus NV | Morgan Stanley | 1.120 | (2.629) | Aker Carbon Capture ASA | Bank of America Merrill Lynch | 12 |
| (1.900) | SBM Offshore NV | Bank of America Merrill Lynch | 1.217 | (2.982) | Aker Carbon Capture ASA | Goldman Sachs | 13 |
| (468) | SBM Offshore NV | Goldman Sachs | 300 | 2.679 | Aker Solutions ASA | Bank of America Merrill Lynch | (7) |
| (1.240) | SBM Offshore NV | Morgan Stanley | 397 | 6.190 | Aker Solutions ASA | Goldman Sachs | (1) |
| 1.326 | Signify NV | Bank of America Merrill Lynch | (4.078) | 1.609 | Austevoll Seafood ASA | Bank of America Merrill Lynch | (1.080) |
| 157 | Signify NV | Goldman Sachs | (483) | 1.830 | Austevoll Seafood ASA | Goldman Sachs | (1.254) |
| 1.210 | Signify NV | Morgan Stanley | (1.873) | 957 | AutoStore Holdings Ltd | Morgan Stanley | 142 |
| (112) | Sligro Food Group NV | Bank of America Merrill Lynch | 31 | 148 | Bakkafrost P | Bank of America Merrill Lynch | (243) |
| (98) | Sligro Food Group NV | Goldman Sachs | 27 | 62 | Bakkafrost P | Goldman Sachs | (103) |
| (262) | TKH Group NV | Bank of America Merrill Lynch | (375) | (30) | Bonheur ASA | Bank of America Merrill Lynch | 9 |
| (381) | TKH Group NV | Goldman Sachs | (545) | (111) | Bonheur ASA | Goldman Sachs | 35 |
| 2.433 | TomTom NV | Bank of America Merrill Lynch | (1.091) | 141 | Borregaard ASA | Bank of America Merrill Lynch | (10) |
| 1.583 | TomTom NV | Goldman Sachs | (710) | 370 | Borregaard ASA | Goldman Sachs | (26) |
| (477) | Universal Music Group NV | Bank of America Merrill Lynch | (69) | (1.909) | BW Energy Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 51 |
| (344) | Universal Music Group NV | Goldman Sachs | (50) | (1.833) | BW Energy Ltd | Goldman Sachs | 49 |
| (715) | Universal Music Group NV | Morgan Stanley | 363 | 2.766 | BW LPG Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 801 |
| 296 | Van Lanschot Kempen NV | Bank of America Merrill Lynch | (664) | (1.794) | Cadeler A/S | Goldman Sachs | (457) |
| 53 | Van Lanschot Kempen NV | Goldman Sachs | (119) | (230) | Cool Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (293) |
| 31 | Vastned Retail NV (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (18) | (1.359) | Cool Co Ltd | Goldman Sachs | (1.730) |
| 22 | Vastned Retail NV (REIT) | Goldman Sachs | (26) | (834) | Crayon Group Holding ASA | Bank of America Merrill Lynch | (2.239) |
| 981 | Wereldhave NV (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 32 | (1.791) | Crayon Group Holding ASA | Goldman Sachs | (4.808) |
| 871 | Wereldhave NV (REIT) | Goldman Sachs | 28 | (139) | DNB Bank ASA | Bank of America Merrill Lynch | (9) |
| 345 | Wolters Kluwer NV | Goldman Sachs | (866) | (1.234) | DNB Bank ASA | Morgan Stanley | 94 |
| 245 | Wolters Kluwer NV | Morgan Stanley | (235) | 6.607 | DNO ASA | Bank of America Merrill Lynch | (252) |
| | | | (14.630) | 11.382 | DNO ASA | Goldman Sachs | (434) |
| | | | | 1.858 | Elkem ASA | Bank of America Merrill Lynch | (506) |
| | Neuseeland | | | 4.605 | Elkem ASA | Goldman Sachs | (1.255) |
| 884 | a2 Milk Co Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 58 | 520 | Equinor ASA | Goldman Sachs | (774) |
| 1.814 | a2 Milk Co Ltd | Goldman Sachs | 120 | 3.011 | Equinor ASA | Morgan Stanley | (4.196) |
| (1.638) | Chorus Ltd | Goldman Sachs | 103 | (1.119) | Europris ASA | Goldman Sachs | 376 |
| (4.379) | EBOS Group Ltd | Morgan Stanley | 2.416 | 38 | FLEX LNG Ltd | Goldman Sachs | (44) |
| (2.237) | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | Goldman Sachs | 4.628 | 418 | Frontline Plc | Bank of America Merrill Lynch | (71) |
| | | | | 2.382 | Frontline Plc | Goldman Sachs | (406) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|---------------------------|-----------------|---|-----------------------------|--------------------------|-----------------|---|
| Norwegen Fortsetzung | | | | Norwegen Fortsetzung | | | |
| 137 | Gjensidige Forsikring ASA | Bank of America | | (1.229) | Telenor ASA | Morgan Stanley | 331 |
| | | Merrill Lynch | 48 | 1.067 | TGS ASA | Bank of America | |
| 361 | Gjensidige Forsikring ASA | Goldman Sachs | 126 | | | Merrill Lynch | (249) |
| 501 | Gjensidige Forsikring ASA | Morgan Stanley | 130 | 1.966 | TGS ASA | Goldman Sachs | (458) |
| 143 | Hafnia Ltd | Bank of America | | 2.317 | TOMRA Systems ASA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (12) | | | Merrill Lynch | 1.360 |
| 163 | Hafnia Ltd | Goldman Sachs | (13) | 1.277 | TOMRA Systems ASA | Goldman Sachs | 750 |
| (616) | Hexagon Composites ASA | Bank of America | | 2.143 | TOMRA Systems ASA | Morgan Stanley | 1.383 |
| | | Merrill Lynch | (21) | 6.426 | Var Energi ASA | Goldman Sachs | (1.117) |
| (1.422) | Hexagon Composites ASA | Goldman Sachs | (48) | 18.828 | Var Energi ASA | Morgan Stanley | (2.953) |
| (3.817) | Hexagon Purus ASA | Bank of America | | 389 | Wallenius Wilhelmsen ASA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (650) | | | Merrill Lynch | (117) |
| (544) | Hexagon Purus ASA | Goldman Sachs | (93) | 598 | Wallenius Wilhelmsen ASA | Goldman Sachs | (125) |
| (316) | Hoegh Autoliners ASA | Goldman Sachs | 193 | (942) | Yara International ASA | Bank of America | |
| (5.514) | Kahoot! ASA | Goldman Sachs | (2.679) | | | Merrill Lynch | 650 |
| 934 | Kongsberg Gruppen ASA | Bank of America | | (924) | Yara International ASA | Morgan Stanley | 721 |
| | | Merrill Lynch | (2.160) | | | | |
| 50 | Kongsberg Gruppen ASA | Goldman Sachs | (116) | | | | (44.759) |
| 2.402 | Kongsberg Gruppen ASA | Morgan Stanley | (7.061) | Portugal | | | |
| (6.748) | MPC Container Ships ASA | Bank of America | | (1.278) | Altri SGPS SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (2.012) | | | Merrill Lynch | 1.190 |
| (4.757) | MPC Container Ships ASA | Goldman Sachs | (1.462) | (3.316) | Altri SGPS SA | Goldman Sachs | 3.087 |
| 1.552 | NEL ASA | Bank of America | | (470.680) | Banco Comercial | | |
| | | Merrill Lynch | (38) | | Portugues SA 'R' | Morgan Stanley | 7.488 |
| 10.769 | NEL ASA | Goldman Sachs | (261) | (863) | Corticeira Amorim | Bank of America | |
| 23.628 | NEL ASA | Morgan Stanley | (1.419) | | SGPS SA | Merrill Lynch | 387 |
| 1.082 | Nordic Semiconductor ASA | Bank of America | | (1.447) | Corticeira Amorim | | |
| | | Merrill Lynch | 669 | | SGPS SA | Goldman Sachs | 649 |
| 771 | Nordic Semiconductor ASA | Goldman Sachs | 477 | (2.181) | CTT-Correios de | | |
| 1.048 | Nordic Semiconductor ASA | Morgan Stanley | 70 | | Portugal SA | Goldman Sachs | 1.094 |
| (154) | Norske Skog ASA | Bank of America | | 1.504 | EDP Renovaveis SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 35 | | | Merrill Lynch | (3.043) |
| (2.199) | Norske Skog ASA | Goldman Sachs | 505 | 20 | EDP Renovaveis SA | Bank of America | |
| (10.364) | Norwegian Air Shuttle ASA | Goldman Sachs | (1.050) | | | Merrill Lynch | (35) |
| 7.200 | Odjell Drilling Ltd | Goldman Sachs | 968 | 1.874 | EDP Renovaveis SA | Goldman Sachs | (3.792) |
| (12.468) | Orkla ASA | Bank of America | | 24 | EDP Renovaveis SA | Goldman Sachs | (62) |
| | | Merrill Lynch | 1.268 | 1.904 | EDP Renovaveis SA | Morgan Stanley | (1.647) |
| (6.351) | Orkla ASA | Morgan Stanley | 945 | 25 | EDP Renovaveis SA | Morgan Stanley | (15) |
| (3.336) | PGS ASA | Bank of America | | (2.074) | Galp Energia SGPS SA | Morgan Stanley | 1.189 |
| | | Merrill Lynch | 41 | (6.494) | Greenvolt-Energias | Bank of America | |
| (23.896) | PGS ASA | Goldman Sachs | 225 | | Renovaveis SA | Merrill Lynch | 2.902 |
| 224 | Protector Forsikring ASA | Bank of America | | (520) | Greenvolt-Energias | | |
| | | Merrill Lynch | 241 | | Renovaveis SA | Goldman Sachs | (2.413) |
| 241 | Protector Forsikring ASA | Goldman Sachs | 259 | (391) | Jeronimo Martins SGPS SA | Bank of America | |
| (2.451) | REC Silicon ASA | Goldman Sachs | (436) | | | Merrill Lynch | (58) |
| (2.043) | Salmar ASA | Bank of America | | (2.813) | Navigator Co SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (4.797) | | | Merrill Lynch | 1.072 |
| (1.660) | Salmar ASA | Morgan Stanley | (4.895) | (5.799) | Navigator Co SA | Goldman Sachs | 2.067 |
| 1.476 | Scatec ASA | Bank of America | | (3.370) | NOS SGPS SA | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 73 | | | Merrill Lynch | 993 |
| 2.889 | Scatec ASA | Goldman Sachs | 142 | (2.563) | NOS SGPS SA | Goldman Sachs | 755 |
| (2.558) | Schibsted ASA 'A' | Bank of America | | 2.478 | REN - Redes Energeticas | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (2.659) | | Nacionais SGPS SA | Merrill Lynch | (53) |
| (513) | Schibsted ASA 'A' | Morgan Stanley | (363) | 11.328 | REN - Redes Energeticas | | |
| 254 | SpareBank 1 Nord Norge | Bank of America | | | Nacionais SGPS SA | Goldman Sachs | (242) |
| | | Merrill Lynch | (50) | 5.427 | Sonae SGPS SA | Bank of America | |
| 786 | SpareBank 1 Nord Norge | Goldman Sachs | (146) | | | Merrill Lynch | (484) |
| 583 | SpareBank 1 SMN | Bank of America | | 3.784 | Sonae SGPS SA | Goldman Sachs | (337) |
| | | Merrill Lynch | 42 | | | | |
| 1.262 | SpareBank 1 SMN | Goldman Sachs | 91 | | | | 10.692 |
| 1.445 | SpareBank 1 SR-Bank ASA | Bank of America | | Singapur | | | |
| | | Merrill Lynch | (88) | (15.700) | AEM Holdings Ltd | Goldman Sachs | (4.175) |
| 764 | SpareBank 1 SR-Bank ASA | Goldman Sachs | (48) | 3.800 | Bumitama Agri Ltd | Bank of America | |
| 225 | Stolt-Nielsen Ltd | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (126) |
| | | Merrill Lynch | (214) | 10.800 | Bumitama Agri Ltd | Goldman Sachs | (359) |
| 313 | Stolt-Nielsen Ltd | Goldman Sachs | (277) | (9.300) | CapitalLand Ascendas | Bank of America | |
| 1.538 | Storebrand ASA | Bank of America | | | (REIT) | Merrill Lynch | 1.237 |
| | | Merrill Lynch | (17) | (13.000) | CapitalLand Ascendas | | |
| (1.408) | Telenor ASA | Bank of America | | | (REIT) | Goldman Sachs | 1.728 |
| | | Merrill Lynch | 991 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|---|-----------------------------|--|-------------------------------|---|
| Singapur Fortsetzung | | | | Singapur Fortsetzung | | | |
| (5.000) | Capitaland Ascendas (REIT) | Morgan Stanley | 406 | (1.100) | Singapore Exchange Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 195 |
| (7.000) | Capitaland China Trust (REIT) | Goldman Sachs | 517 | (1.600) | Singapore Exchange Ltd | Goldman Sachs | 284 |
| 16.400 | Capitaland India Trust (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | 242 | (2.300) | Singapore Exchange Ltd | Morgan Stanley | 68 |
| 18.400 | Capitaland India Trust (Unit) | Goldman Sachs | 272 | 133.400 | Singapore Post Ltd | Morgan Stanley | (2.463) |
| 600 | City Developments Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (115) | (5.100) | Singapore Technologies Engineering Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (151) |
| 3.600 | City Developments Ltd | Morgan Stanley | (239) | (1.100) | Singapore Technologies Engineering Ltd | Goldman Sachs | (33) |
| 5.400 | ComfortDelGro Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (319) | (6.800) | Singapore Technologies Engineering Ltd | Morgan Stanley | 502 |
| 2.900 | ComfortDelGro Corp Ltd | Goldman Sachs | (171) | (3.500) | Singapore Telecommunications Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 155 |
| 10.800 | ComfortDelGro Corp Ltd (500) | Morgan Stanley | (80) | (11.000) | Singapore Telecommunications Ltd | Goldman Sachs | 488 |
| (1.700) | DBS Group Holdings Ltd | Goldman Sachs | 244 | (11.400) | Singapore Telecommunications Ltd | Morgan Stanley | 505 |
| (1.700) | DBS Group Holdings Ltd | Morgan Stanley | 766 | 5.500 | StarHub Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (41) |
| 17.300 | Far East Hospitality Trust (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | (64) | 2.900 | StarHub Ltd | Goldman Sachs | (21) |
| 10.100 | Far East Hospitality Trust (Unit) | Goldman Sachs | (37) | 2.000 | Suntec (REIT) | Goldman Sachs | (59) |
| 1.600 | First Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 95 | 4.200 | Suntec (REIT) | Morgan Stanley | (93) |
| 10.400 | First Resources Ltd | Goldman Sachs | 615 | (3.200) | UOL Group Ltd | Goldman Sachs | 1.206 |
| 5.100 | Frasers Centrepoint Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (339) | (3.000) | UOL Group Ltd | Morgan Stanley | 820 |
| 2.100 | Frasers Centrepoint Trust (REIT) | Goldman Sachs | (140) | (900) | Venture Corp Ltd | Goldman Sachs | 66 |
| (1.300) | Frencken Group Ltd | Goldman Sachs | 58 | (26.300) | Yanlord Land Group Ltd | Goldman Sachs | 1.651 |
| (15.700) | Genting Singapore Ltd | Goldman Sachs | 232 | | | | 13.433 |
| (4.800) | Genting Singapore Ltd | Morgan Stanley | 35 | Spanien | | | |
| 3.800 | Golden Agri-Resources Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (14) | (49) | Acciona SA | Bank of America Merrill Lynch | 520 |
| 5.000 | Golden Agri-Resources Ltd | Goldman Sachs | (18) | 60 | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | Morgan Stanley | (16) |
| 4.100 | Hongkong Land Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.025) | 894 | Almirall SA | Bank of America Merrill Lynch | (377) |
| 900 | Hongkong Land Holdings Ltd | Goldman Sachs | (225) | 1.619 | Almirall SA | Goldman Sachs | (683) |
| 3.400 | Hongkong Land Holdings Ltd | Morgan Stanley | (544) | 894 | Almirall SA (Right) | Bank of America Merrill Lynch | (8) |
| 2.400 | Hour Glass Ltd | Goldman Sachs | (89) | 1.619 | Almirall SA (Right) | Goldman Sachs | (14) |
| 27.500 | Hutchison Port Holdings Trust (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | (165) | (1.105) | Amadeus IT Group SA | Bank of America Merrill Lynch | (1.959) |
| 53.200 | Hutchison Port Holdings Trust (Unit) | Goldman Sachs | (319) | (345) | Amadeus IT Group SA | Goldman Sachs | (612) |
| (400) | Jardine Cycle & Carriage Ltd | Goldman Sachs | 591 | (984) | Amadeus IT Group SA | Morgan Stanley | (168) |
| (200) | Jardine Matheson Holdings Ltd | Goldman Sachs | 532 | 456 | Applus Services SA | Bank of America Merrill Lynch | (15) |
| (11.900) | Lendlease Global Commercial (REIT) | Goldman Sachs | 176 | 1.027 | Applus Services SA | Goldman Sachs | (19) |
| (34.300) | Olam Group Ltd | Morgan Stanley | 1.774 | (515) | Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA | Bank of America Merrill Lynch | 63 |
| (19.700) | OUE Commercial (REIT) | Goldman Sachs | (146) | (268) | Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA | Goldman Sachs | 33 |
| (4.300) | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (32) | 588 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Bank of America Merrill Lynch | (108) |
| (2.800) | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | Goldman Sachs | (21) | 1.156 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Goldman Sachs | (193) |
| (1.100) | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | Morgan Stanley | 24 | 9.338 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Morgan Stanley | (3.370) |
| (900) | PARAGON (REIT) | Goldman Sachs | (17) | 24.215 | Banco de Sabadell SA | Bank of America Merrill Lynch | 21 |
| 13.700 | Sembcorp Industries Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.137 | 26.341 | Banco de Sabadell SA | Goldman Sachs | 22 |
| 11.900 | Sembcorp Industries Ltd | Goldman Sachs | 2.725 | 33.226 | Banco de Sabadell SA | Morgan Stanley | (1.508) |
| 18.300 | Sembcorp Industries Ltd | Morgan Stanley | 2.028 | (10.504) | Banco Santander SA | Bank of America Merrill Lynch | 903 |
| 5.700 | Sheng Siong Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (295) | 2.005 | Bankinter SA | Bank of America Merrill Lynch | 535 |
| 5.100 | Sheng Siong Group Ltd | Goldman Sachs | (264) | 1.240 | Bankinter SA | Goldman Sachs | 331 |
| 5.500 | Singapore Airlines Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.331 | 2.201 | Bankinter SA | Morgan Stanley | (5) |
| 3.800 | Singapore Airlines Ltd | Goldman Sachs | 1.250 | (407) | Cellnex Telecom SA | Bank of America Merrill Lynch | (61) |
| 6.100 | Singapore Airlines Ltd | Morgan Stanley | (323) | (1.625) | Cellnex Telecom SA | Goldman Sachs | (243) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|--|----------------------------------|---|----------------------------|------------------------------------|---|---|
| Spanien Fortsetzung | | | | Spanien Fortsetzung | | | |
| (896) | Cellnex Telecom SA | Morgan Stanley | 306 | 1.124 | Melia Hotels | | |
| 1.371 | Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA | Bank of America Merrill Lynch | (252) | 4.190 | Merlin Properties Socimi SA (REIT) | Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch | 600 |
| 1.240 | Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA | Goldman Sachs | (243) | 9.115 | Merlin Properties Socimi SA (REIT) | Goldman Sachs | 243 |
| (340) | CIE Automotive SA | Bank of America Merrill Lynch | 333 | 3.835 | Merlin Properties Socimi SA (REIT) | Morgan Stanley | (61) |
| (351) | CIE Automotive SA | Goldman Sachs | 330 | (79) | Naturgy Energy Group SA | Morgan Stanley | 13 |
| (96) | Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA | Goldman Sachs | (10) | (1.320) | Opdenergy Holdings SA | Bank of America Merrill Lynch | (331) |
| (168) | Corp ACCIONA Energias Renovables SA | Bank of America Merrill Lynch | 230 | (420) | Opdenergy Holdings SA | Goldman Sachs | (105) |
| (351) | Corp ACCIONA Energias Renovables SA | Goldman Sachs | 480 | 228 | Pharma Mar SA | Bank of America Merrill Lynch | (696) |
| (450) | Corp ACCIONA Energias Renovables SA | Morgan Stanley | 279 | 379 | Pharma Mar SA | Goldman Sachs | (1.157) |
| 202 | Ebro Foods SA | Bank of America Merrill Lynch | (35) | (911) | Prosegur Cia de Seguridad SA | Bank of America Merrill Lynch | 2 |
| 110 | Ebro Foods SA | Goldman Sachs | (19) | (285) | Prosegur Cia de Seguridad SA | Goldman Sachs | 1 |
| (5.947) | Ence Energia y Celulosa SA | Bank of America Merrill Lynch | 3.201 | 686 | Sacyr SA | Bank of America Merrill Lynch | (50) |
| (3.188) | Ence Energia y Celulosa SA | Goldman Sachs | 1.471 | 2.665 | Sacyr SA | Goldman Sachs | (194) |
| (516) | Endesa SA | Bank of America Merrill Lynch | (201) | 2.427 | Sacyr SA | Morgan Stanley | (461) |
| (2.023) | Endesa SA | Goldman Sachs | (789) | (2.668) | Soltec Power Holdings SA | Bank of America Merrill Lynch | 695 |
| (1.209) | Endesa SA | Morgan Stanley | (400) | (375) | Talgo SA | Bank of America Merrill Lynch | (34) |
| (3.003) | Faes Farma SA | Bank of America Merrill Lynch | 256 | (479) | Talgo SA | Goldman Sachs | (44) |
| (5.350) | Faes Farma SA | Goldman Sachs | 472 | 643 | Tecnicas Reunidas SA | Bank of America Merrill Lynch | (3) |
| 1.301 | Fluidra SA | Bank of America Merrill Lynch | (42) | 254 | Tecnicas Reunidas SA | Goldman Sachs | (1) |
| 611 | Fluidra SA | Goldman Sachs | (20) | 8.658 | Unicaja Banco SA | Bank of America Merrill Lynch | (355) |
| 1.085 | Fluidra SA | Morgan Stanley | (58) | 13.608 | Unicaja Banco SA | Goldman Sachs | (581) |
| (1.535) | Gestamp Automocion SA | Bank of America Merrill Lynch | (367) | 12 | Vidrala SA | Bank of America Merrill Lynch | 13 |
| (775) | Gestamp Automocion SA | Goldman Sachs | (185) | 26 | Vidrala SA | Goldman Sachs | (13) |
| (1.442) | Global Dominion Access SA | Bank of America Merrill Lynch | (616) | 282 | Viscofan SA | Bank of America Merrill Lynch | (452) |
| (112) | Grenergy Renovables SA | Bank of America Merrill Lynch | 407 | 116 | Viscofan SA | Goldman Sachs | (186) |
| (589) | Grenergy Renovables SA | Goldman Sachs | 2.038 | | | | (4.263) |
| (562) | Industria de Diseno Textil SA | Bank of America Merrill Lynch | (95) | Schweden | | | |
| (1.254) | Industria de Diseno Textil SA | Goldman Sachs | (624) | 467 | AAK AB | Bank of America Merrill Lynch | (258) |
| (618) | Industria de Diseno Textil SA | Morgan Stanley | 204 | 1.993 | AAK AB | Goldman Sachs | (1.100) |
| (5.241) | Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 112 | (3.597) | AcadeMedia AB | Bank of America Merrill Lynch | 1.592 |
| (919) | Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT) | Goldman Sachs | 20 | (6.996) | AcadeMedia AB | Goldman Sachs | 3.027 |
| (5.834) | Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT) | Morgan Stanley | 343 | 359 | AddLife AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (43) |
| 313 | Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA | Bank of America Merrill Lynch | (388) | 170 | AddLife AB 'B' | Goldman Sachs | (20) |
| 34 | Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA | Goldman Sachs | (42) | 2.653 | AddTech AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 3.285 |
| (7.325) | Linea Directa Aseguradora SA Cia de Seguros y Reaseguros | Bank of America Merrill Lynch | (318) | 3.702 | AddTech AB 'B' | Goldman Sachs | 4.836 |
| (6.545) | Linea Directa Aseguradora SA Cia de Seguros y Reaseguros | Goldman Sachs | (356) | (509) | AFRY AB | Bank of America Merrill Lynch | 834 |
| 1.284 | Mapfre SA | Bank of America Merrill Lynch | (21) | (469) | AFRY AB | Goldman Sachs | 768 |
| 5.637 | Mapfre SA | Goldman Sachs | (90) | 3.349 | Alleima AB | Bank of America Merrill Lynch | (1.202) |
| 1.927 | Mapfre SA | Morgan Stanley | (45) | 3.555 | Alleima AB | Goldman Sachs | (1.247) |
| 837 | Melia Hotels International SA | Bank of America Merrill Lynch | 447 | (197) | Ambea AB | Goldman Sachs | 13 |
| | | | | 1.193 | Arjo AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (450) |
| | | | | 4.001 | Arjo AB 'B' | Goldman Sachs | (1.509) |
| | | | | 3.048 | Atlas Copco AB 'A' | Morgan Stanley | 1.052 |
| | | | | 1.243 | Atlas Copco AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 623 |
| | | | | 2.695 | Atlas Copco AB 'B' | Goldman Sachs | 1.351 |
| | | | | 1.183 | Atlas Copco AB 'B' | Morgan Stanley | 294 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|-----------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweden Fortsetzung | | | |
| (1.443) | Attendo AB | Bank of America Merrill Lynch | 179 | (976) | Duni AB | Goldman Sachs | 1.230 |
| (550) | Attendo AB | Goldman Sachs | 68 | (856) | Dustin Group AB | Bank of America Merrill Lynch | 476 |
| 506 | Avanza Bank Holding AB | Bank of America Merrill Lynch | 37 | (2.516) | Dustin Group AB | Goldman Sachs | 1.398 |
| 780 | Avanza Bank Holding AB | Morgan Stanley | (230) | (3.090) | Electrolux AB 'B' | Goldman Sachs | 5.572 |
| 1.362 | Beijer Ref AB | Bank of America Merrill Lynch | 38 | (1.529) | Electrolux Professional AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 661 |
| 2.186 | Beijer Ref AB | Goldman Sachs | 60 | (348) | Electrolux Professional AB 'B' | Goldman Sachs | 150 |
| 993 | Beijer Ref AB | Morgan Stanley | 292 | 2.015 | Elekta AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (1.542) |
| 2.352 | Betsson AB | Bank of America Merrill Lynch | 530 | 559 | Elekta AB 'B' | Goldman Sachs | (428) |
| 1.574 | Betsson AB | Goldman Sachs | 355 | 910 | Elekta AB 'B' | Morgan Stanley | (681) |
| 3.559 | Betsson AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (3.552) | (9.626) | Embracer Group AB | Bank of America Merrill Lynch | 24.859 |
| 2.104 | Betsson AB 'B' | Goldman Sachs | (2.339) | 11.818 | Embracer Group AB | Goldman Sachs | (30.519) |
| (327) | Bilia AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 126 | (6.646) | Embracer Group AB | Morgan Stanley | 9.853 |
| (591) | Bilia AB 'A' | Goldman Sachs | 228 | 1.882 | Epiroc AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.502) |
| (6.205) | Billerud AB | Bank of America Merrill Lynch | 7.028 | 2.930 | Epiroc AB 'A' | Goldman Sachs | (3.895) |
| (2.966) | Billerud AB | Goldman Sachs | 3.506 | 2.482 | Epiroc AB 'A' | Morgan Stanley | (4.236) |
| (22) | BioArctic AB | Bank of America Merrill Lynch | (24) | (1.758) | Fabege AB | Goldman Sachs | 398 |
| (789) | BioArctic AB | Goldman Sachs | (1.016) | 7.407 | Fortnox AB | Bank of America Merrill Lynch | (5.024) |
| 1.489 | BioGaia AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 301 | 1.297 | Fortnox AB | Goldman Sachs | (928) |
| 1.413 | BioGaia AB 'B' | Goldman Sachs | 286 | 915 | Getinge AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (295) |
| 1 | Biotage AB | Bank of America Merrill Lynch | (1) | 695 | Getinge AB 'B' | Goldman Sachs | (224) |
| 2.124 | Biotage AB | Goldman Sachs | (1.133) | 899 | Getinge AB 'B' | Morgan Stanley | (248) |
| 502 | Boliden AB | Goldman Sachs | (1.007) | (345) | Granges AB | Bank of America Merrill Lynch | 187 |
| 1.402 | Boliden AB | Morgan Stanley | (1.458) | (1.464) | Granges AB | Goldman Sachs | 795 |
| 897 | Bravida Holding AB | Bank of America Merrill Lynch | (708) | (1.316) | H & M Hennes & Mauritz AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 344 |
| 1.208 | Bravida Holding AB | Goldman Sachs | (1.100) | (430) | H & M Hennes & Mauritz AB 'B' | Morgan Stanley | 113 |
| 59 | Bufab AB | Goldman Sachs | (43) | (718) | Hemnet Group AB | Bank of America Merrill Lynch | (1.151) |
| 108 | Bure Equity AB | Bank of America Merrill Lynch | (135) | (1.429) | Hemnet Group AB | Goldman Sachs | (2.419) |
| 155 | Bure Equity AB | Goldman Sachs | (194) | (140) | Hexagon AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (131) |
| 265 | Camurus AB | Bank of America Merrill Lynch | 47 | (2.895) | Hexagon AB 'B' | Morgan Stanley | (1.798) |
| 102 | Camurus AB | Goldman Sachs | 133 | 708 | Hexpol AB | Bank of America Merrill Lynch | (168) |
| (38) | Catena AB | Bank of America Merrill Lynch | (5) | 522 | Hexpol AB | Goldman Sachs | (148) |
| (156) | Catena AB | Goldman Sachs | (20) | 227 | HMS Networks AB | Bank of America Merrill Lynch | (146) |
| 4 | Cellavision AB | Goldman Sachs | 7 | 426 | HMS Networks AB | Goldman Sachs | (274) |
| (794) | Cibus Nordic Real Estate AB | Bank of America Merrill Lynch | 375 | (989) | Hufvudstaden AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 318 |
| (457) | Cibus Nordic Real Estate AB | Goldman Sachs | 216 | (1.835) | Hufvudstaden AB 'A' | Goldman Sachs | 591 |
| (745) | Cint Group AB | Morgan Stanley | 77 | (5.197) | Husqvarna AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 5.546 |
| (849) | Clas Ohlson AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 484 | (1.763) | Husqvarna AB 'B' | Morgan Stanley | 1.612 |
| (1.170) | Clas Ohlson AB 'B' | Goldman Sachs | 667 | (693) | Implantica AG SDR 'A' | Goldman Sachs | (87) |
| (484) | Cloetta AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 46 | 158 | Industrivarden AB 'A' | Goldman Sachs | 16 |
| (3.393) | Cloetta AB 'B' | Goldman Sachs | 322 | 800 | Industrivarden AB 'A' | Morgan Stanley | (103) |
| (1.318) | Coor Service Management Holding AB | Bank of America Merrill Lynch | 1.025 | 2.270 | Industrivarden AB 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (21) |
| (1.837) | Coor Service Management Holding AB | Goldman Sachs | 1.622 | 3.317 | Industrivarden AB 'C' | Goldman Sachs | (31) |
| 3.603 | Corem Property Group AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (338) | 1.530 | Industrivarden AB 'C' | Morgan Stanley | (380) |
| 7.580 | Corem Property Group AB 'B' | Goldman Sachs | (711) | 329 | Indutrade AB | Bank of America Merrill Lynch | (64) |
| (993) | Dios Fastigheter AB | Goldman Sachs | 434 | 95 | Indutrade AB | Morgan Stanley | (31) |
| (3.201) | Dometic Group AB | Bank of America Merrill Lynch | 1.715 | (691) | Instalco AB | Bank of America Merrill Lynch | 45 |
| (2.571) | Dometic Group AB | Goldman Sachs | 1.305 | (740) | Instalco AB | Goldman Sachs | 48 |
| (218) | Duni AB | Bank of America Merrill Lynch | 275 | 1.152 | Intrum AB | Bank of America Merrill Lynch | (437) |
| | | | | 1.295 | Intrum AB | Goldman Sachs | (491) |
| | | | | 100 | Investment AB Latour 'B' | Morgan Stanley | (75) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|------------------------------|-------------------------------|---|-----------------------------|---|-------------------------------|---|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweden Fortsetzung | | | |
| 135 | INVISIO AB | Bank of America Merrill Lynch | (76) | (362) | PowerCell Sweden AB | Goldman Sachs | 261 |
| 132 | INVISIO AB | Goldman Sachs | (79) | (1.458) | Ratos AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 223 |
| (268) | Inwido AB | Bank of America Merrill Lynch | 133 | (2.373) | Ratos AB 'B' | Goldman Sachs | 362 |
| (316) | Inwido AB | Goldman Sachs | 157 | 428 | Resurs Holding AB | Bank of America Merrill Lynch | 13 |
| (371) | JM AB | Bank of America Merrill Lynch | 686 | 635 | Resurs Holding AB | Goldman Sachs | 19 |
| (480) | JM AB | Goldman Sachs | 888 | (1.176) | Rvrc Holding AB | Bank of America Merrill Lynch | 238 |
| 261 | Kambi Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (53) | (667) | Rvrc Holding AB | Goldman Sachs | 135 |
| 408 | Kambi Group Plc | Goldman Sachs | (83) | 166 | Saab AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (18) |
| (573) | Kinnevik AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 453 | 192 | Saab AB 'B' | Morgan Stanley | (35) |
| (1.463) | Kinnevik AB 'B' | Morgan Stanley | 1.084 | 553 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'D' | Bank of America Merrill Lynch | (215) |
| 278 | L E Lundbergforetagen AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (903) | 2.439 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'D' | Goldman Sachs | (948) |
| 96 | L E Lundbergforetagen AB 'B' | Goldman Sachs | (312) | 232 | Sandvik AB | Goldman Sachs | (182) |
| 117 | L E Lundbergforetagen AB 'B' | Morgan Stanley | (334) | 462 | Scandic Hotels Group AB | Bank of America Merrill Lynch | 175 |
| (411) | Lindab International AB | Bank of America Merrill Lynch | 250 | 2.572 | Scandic Hotels Group AB | Goldman Sachs | 975 |
| (834) | Lindab International AB | Goldman Sachs | 506 | 73 | Sdiptech AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (122) |
| (348) | Loomis AB | Bank of America Merrill Lynch | 589 | 223 | Sdiptech AB 'B' | Goldman Sachs | (373) |
| (605) | Loomis AB | Goldman Sachs | 1.024 | 1.315 | Sectra AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 1.117 |
| (33) | MEKO AB | Goldman Sachs | 55 | 745 | Sectra AB 'B' | Goldman Sachs | 617 |
| 199 | MIPS AB | Bank of America Merrill Lynch | (84) | (2.329) | Securitas AB 'B' | Morgan Stanley | 951 |
| 337 | MIPS AB | Goldman Sachs | (143) | (9.156) | Sinch AB | Goldman Sachs | (88) |
| 1.118 | Mycronic AB | Bank of America Merrill Lynch | 782 | (3.799) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 437 |
| 1.092 | Mycronic AB | Goldman Sachs | 715 | (1.132) | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | Morgan Stanley | 177 |
| (1.116) | NCC AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 873 | (1.304) | Skanska AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 996 |
| (372) | NCC AB 'B' | Goldman Sachs | 291 | (183) | Skanska AB 'B' | Morgan Stanley | 113 |
| 123 | New Wave Group AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (88) | (421) | SkiStar AB | Bank of America Merrill Lynch | 225 |
| 53 | New Wave Group AB 'B' | Goldman Sachs | (73) | (156) | SkiStar AB | Goldman Sachs | 83 |
| 2.113 | Nibe Industrier AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (2.615) | 1.946 | SSAB AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (24) |
| 1.767 | Nibe Industrier AB 'B' | Goldman Sachs | (2.186) | 4.845 | SSAB AB 'B' | Goldman Sachs | 49 |
| 381 | Nibe Industrier AB 'B' | Morgan Stanley | (375) | (8.736) | Stillfront Group AB | Bank of America Merrill Lynch | 2.222 |
| 1.173 | Nolato AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (448) | (8.729) | Stillfront Group AB | Goldman Sachs | 2.119 |
| 1.349 | Nolato AB 'B' | Goldman Sachs | (515) | 1.477 | Storskogen Group AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (145) |
| (6.574) | Nordea Bank Abp | Bank of America Merrill Lynch | 387 | 1.174 | Storskogen Group AB 'B' | Goldman Sachs | (137) |
| (5.801) | Nordea Bank Abp | Morgan Stanley | 1.131 | (344) | Surgical Science Sweden AB | Goldman Sachs | (1.212) |
| (493) | Nordnet AB publ | Bank of America Merrill Lynch | 91 | (1.282) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 77 |
| (316) | Nordnet AB publ | Goldman Sachs | 58 | (1.366) | Svenska Cellulosa AB SCA 'B' | Morgan Stanley | (82) |
| 15 | NP3 Fastigheter AB | Goldman Sachs | (14) | (138) | SwedenCare AB | Bank of America Merrill Lynch | 1 |
| 2.597 | Nyfosa AB | Bank of America Merrill Lynch | (1.493) | (169) | Swedish Orphan Biovitrum AB | Bank of America Merrill Lynch | 286 |
| 1.440 | Nyfosa AB | Goldman Sachs | (828) | (545) | Swedish Orphan Biovitrum AB | Morgan Stanley | 983 |
| (3.105) | Orron Energy AB | Bank of America Merrill Lynch | 192 | (1.952) | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | Morgan Stanley | (93) |
| (723) | Orron Energy AB | Goldman Sachs | 4 | (6.876) | Telia Co AB | Bank of America Merrill Lynch | 1.069 |
| (2.511) | OX2 AB | Goldman Sachs | 1.127 | (21.667) | Telia Co AB | Morgan Stanley | 2.248 |
| (990) | Pandex AB | Bank of America Merrill Lynch | (19) | 324 | Thule Group AB | Bank of America Merrill Lynch | 176 |
| (777) | Pandex AB | Goldman Sachs | (18) | 426 | Thule Group AB | Goldman Sachs | 231 |
| 29 | Paradox Interactive AB | Bank of America Merrill Lynch | 23 | 69 | Troax Group AB | Bank of America Merrill Lynch | (72) |
| 231 | Paradox Interactive AB | Goldman Sachs | 183 | | | | |
| (1.880) | Peab AB 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 713 | | | | |
| (2.691) | Peab AB 'B' | Goldman Sachs | 1.020 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------|--------------------------|-----------------|---|----------------------------|--|-----------------|---|
| Schweden Fortsetzung | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| 671 | Troax Group AB | Goldman Sachs | (704) | 37 | Belimo Holding AG Reg | Bank of America | |
| (114) | Viaplay Group AB | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (770) |
| | | Merrill Lynch | 310 | 33 | Belimo Holding AG Reg | Goldman Sachs | (687) |
| (53) | Viaplay Group AB | Goldman Sachs | 144 | 8 | Belimo Holding AG Reg | Morgan Stanley | (140) |
| 48 | Vitec Software Group AB | Bank of America | | (2) | Bell Food Group AG Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (26) | | | Merrill Lynch | 25 |
| 34 | Vitec Software Group AB | Goldman Sachs | (19) | (6) | Bell Food Group AG Reg | Goldman Sachs | 38 |
| 320 | Vitrolife AB | Bank of America | | 18 | Bossard Holding AG Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (654) | | | Merrill Lynch | (266) |
| 159 | Vitrolife AB | Goldman Sachs | (325) | 32 | Bossard Holding AG Reg | Goldman Sachs | (473) |
| (625) | Volvo AB 'B' | Bank of America | | 68 | Bucher Industries AG Reg | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 345 | | | Merrill Lynch | (760) |
| (1.496) | Volvo AB 'B' | Morgan Stanley | 1.115 | 53 | Bucher Industries AG Reg | Goldman Sachs | (592) |
| 1.271 | Volvo Car AB 'B' | Bank of America | | (6) | Burckhardt Compression Holding AG | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (22) | | | Merrill Lynch | (20) |
| 533 | Volvo Car AB 'B' | Goldman Sachs | (9) | (4) | Burckhardt Compression Holding AG | Goldman Sachs | (13) |
| (3.813) | Wallenstam AB 'B' | Bank of America | | 49 | Burkhalter Holding AG | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 912 | | | Merrill Lynch | (263) |
| (3.437) | Wallenstam AB 'B' | Goldman Sachs | 822 | 33 | Burkhalter Holding AG | Goldman Sachs | (177) |
| (1.774) | Wihlborgs Fastigheter AB | Bank of America | | (22) | Bystronic AG | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 338 | | | Merrill Lynch | 469 |
| (2.730) | Wihlborgs Fastigheter AB | Goldman Sachs | 565 | (23) | Bystronic AG | Goldman Sachs | 495 |
| 74 | Xvivo Perfusion AB | Bank of America | | (486) | Cembra Money Bank AG | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (123) | | | Merrill Lynch | 163 |
| | | | 33.528 | (387) | Cembra Money Bank AG | Goldman Sachs | 186 |
| | | | | 1 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (329) |
| | | | | 5 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | Morgan Stanley | (877) |
| | | | | 1 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG Reg | | — |
| | | | | 78 | Cie Financiere Richemont SA Reg | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (872) |
| | | | | (6) | Coltene Holding AG Reg | Goldman Sachs | 3 |
| | | | | 18 | Comet Holding AG Reg | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 367 |
| | | | | 23 | Comet Holding AG Reg | Goldman Sachs | 469 |
| | | | | (60) | Daetwyler Holding AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 1.346 |
| | | | | (112) | Daetwyler Holding AG | Goldman Sachs | 2.281 |
| | | | | (234) | DocMorris AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 1.410 |
| | | | | (85) | DocMorris AG | Goldman Sachs | 279 |
| | | | | (66) | dormakaba Holding AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 868 |
| | | | | (87) | dormakaba Holding AG | Goldman Sachs | 1.144 |
| | | | | 2.151 | Dufry AG Reg | Morgan Stanley | (5.515) |
| | | | | (651) | EFG International AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (364) |
| | | | | (996) | EFG International AG | Goldman Sachs | (557) |
| | | | | (13) | Emmi AG Reg | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 285 |
| | | | | (18) | Emmi AG Reg | Goldman Sachs | 394 |
| | | | | (7) | Emmi AG Reg | Morgan Stanley | 23 |
| | | | | (69) | EMS-Chemie Holding AG Reg | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 1.172 |
| | | | | (10) | EMS-Chemie Holding AG Reg | Goldman Sachs | 170 |
| | | | | (12) | EMS-Chemie Holding AG Reg | | |
| | | | | (4) | Forbo Holding AG Reg | Morgan Stanley | 59 |
| | | | | | | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 125 |
| | | | | (27) | Forbo Holding AG Reg | Goldman Sachs | 994 |
| | | | | (88) | Galenica AG | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 453 |
| | | | | (1.146) | Galenica AG | Morgan Stanley | 4.332 |
| | | | | 11 | Geberit AG Reg | Goldman Sachs | (192) |
| | | | | 158 | Geberit AG Reg | Morgan Stanley | (2.233) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|---|----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|---|
| Schweiz Fortsetzung | | | | Schweiz Fortsetzung | | | |
| 22 | Givaudan SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | (3.182) | (449) | PolyPeptide Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 758 |
| 6 | Givaudan SA Reg | Goldman Sachs | (868) | (767) | PolyPeptide Group AG | Goldman Sachs | 1.233 |
| 17 | Givaudan SA Reg | Morgan Stanley | 224 | (43) | Rieter Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 151 |
| 69 | Gurit Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (552) | (21) | Rieter Holding AG Reg | Goldman Sachs | 83 |
| 107 | Gurit Holding AG | Goldman Sachs | (856) | (17) | Roche Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (53) |
| 1.214 | Holcim AG | Bank of America Merrill Lynch | (2.636) | 103 | Roche Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (226) |
| 37 | Holcim AG | Goldman Sachs | (91) | (27) | Roche Holding AG | Goldman Sachs | 23 |
| 1.213 | Holcim AG | Morgan Stanley | (3.016) | 99 | Roche Holding AG | Goldman Sachs | (217) |
| 42 | Huber + Suhner AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (64) | (132) | Roche Holding AG | Morgan Stanley | 118 |
| 142 | Huber + Suhner AG Reg | Goldman Sachs | (218) | 138 | Roche Holding AG | Morgan Stanley | — |
| (21) | Implenia AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (141) | 85 | Schindler Holding AG | Goldman Sachs | (773) |
| (33) | Implenia AG Reg | Goldman Sachs | (222) | 13 | Schindler Holding AG | Morgan Stanley | (106) |
| 10 | Inficon Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 537 | (160) | Schindler Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 1.017 |
| 13 | Inficon Holding AG Reg | Goldman Sachs | 698 | (106) | Schindler Holding AG Reg | Goldman Sachs | 674 |
| (1) | Interroll Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 241 | (81) | Schindler Holding AG Reg | Morgan Stanley | 630 |
| (3) | Interroll Holding AG Reg | Goldman Sachs | 723 | (4) | Schweiter Technologies AG | Bank of America Merrill Lynch | 160 |
| (21) | Julius Baer Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 150 | (10) | Schweiter Technologies AG | Goldman Sachs | 376 |
| (378) | Julius Baer Group Ltd | Goldman Sachs | 2.700 | (13) | Sensirion Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | 10 |
| (355) | Julius Baer Group Ltd | Morgan Stanley | 2.731 | (6) | Sensirion Holding AG | Goldman Sachs | (13) |
| 12 | Kardex Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (84) | (52) | SFS Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (75) |
| 28 | Kardex Holding AG Reg | Goldman Sachs | (196) | (178) | SFS Group AG | Goldman Sachs | (351) |
| (55) | Komax Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 663 | (32) | SGS SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | (17) |
| (77) | Komax Holding AG Reg | Goldman Sachs | 866 | (14) | Siegfried Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 514 |
| 50 | Kuehne + Nagel International AG Reg | Morgan Stanley | (131) | (27) | Siegfried Holding AG Reg | Goldman Sachs | 991 |
| (193) | Landis+Gyr Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 328 | (233) | SIG Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 61 |
| (304) | Landis+Gyr Group AG | Goldman Sachs | 516 | (576) | SIG Group AG | Goldman Sachs | 151 |
| 1 | LEM Holding SA Reg | Goldman Sachs | 131 | (711) | SIG Group AG | Morgan Stanley | 499 |
| (60) | Leonteq AG | Bank of America Merrill Lynch | 115 | 15 | Sika AG Reg | Goldman Sachs | (11) |
| (188) | Leonteq AG | Goldman Sachs | 394 | 354 | Sika AG Reg | Morgan Stanley | (2.638) |
| (17) | Lonza Group AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 272 | (121) | SKAN Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 635 |
| (56) | Lonza Group AG Reg | Goldman Sachs | 896 | (118) | SKAN Group AG | Goldman Sachs | 724 |
| (53) | Lonza Group AG Reg | Morgan Stanley | 430 | (1.404) | Softwareone Holding AG | Bank of America Merrill Lynch | (323) |
| 6 | Medacta Group SA | Bank of America Merrill Lynch | (62) | (1.168) | Softwareone Holding AG | Goldman Sachs | (269) |
| (64.061) | Meyer Burger Technology AG | Bank of America Merrill Lynch | 70 | (44) | Sonova Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 2.126 |
| (579) | Mobilezone Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 964 | (17) | St Galler Kantonalbank AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 263 |
| (1.277) | Mobilezone Holding AG Reg | Goldman Sachs | 1.275 | (47) | St Galler Kantonalbank AG Reg | Goldman Sachs | 792 |
| (17) | Mobimo Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 65 | (714) | Stadler Rail AG | Goldman Sachs | 2.425 |
| (90) | Mobimo Holding AG Reg | Goldman Sachs | 345 | (28) | Straumann Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 275 |
| 436 | Nestle SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | (2.819) | (21) | Straumann Holding AG Reg | Morgan Stanley | 170 |
| 1.427 | Nestle SA Reg | Goldman Sachs | (9.225) | 85 | Sulzer AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (214) |
| (4.671) | OC Oerlikon Corp AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 1.728 | 223 | Sulzer AG Reg | Goldman Sachs | (562) |
| (6.092) | OC Oerlikon Corp AG Reg | Goldman Sachs | 2.226 | 124 | Swatch Group AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (598) |
| 99 | Orior AG | Bank of America Merrill Lynch | (553) | (61) | Swiss Life Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 561 |
| 154 | Orior AG | Goldman Sachs | (861) | (73) | Swiss Life Holding AG Reg | Goldman Sachs | 672 |
| 7 | Partners Group Holding AG | Goldman Sachs | (179) | (41) | Swiss Life Holding AG Reg | Morgan Stanley | 234 |
| 21 | Partners Group Holding AG | Morgan Stanley | (709) | 53 | Swiss Prime Site AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (232) |
| (204) | Peach Property Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 232 | 287 | Swiss Prime Site AG Reg | Morgan Stanley | (975) |
| (252) | Peach Property Group AG | Goldman Sachs | 287 | (20) | Swisscom AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 153 |
| | | | | (24) | Swisscom AG Reg | Goldman Sachs | 352 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|----------------------------|---------------------------------|----------------------------------|---|-----------------------------------|---|----------------------------------|---|
| Schweiz Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (211) | Swisscom AG Reg | Morgan Stanley | 951 | 239 | ASOS Plc | Bank of America | |
| 21 | Swissquote Group Holding SA Reg | Bank of America Merrill Lynch | 25 | 202 | ASOS Plc | Merrill Lynch | (164) |
| 123 | Swissquote Group Holding SA Reg | Goldman Sachs | 203 | (3.050) | Associated British Foods Plc | Bank of America Merrill Lynch | (139) |
| 189 | Temenos AG Reg | Morgan Stanley | (228) | (2.282) | Associated British Foods Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2.662 |
| (8) | TX Group AG | Bank of America Merrill Lynch | (4) | (3.217) | Associated British Foods Plc | Goldman Sachs | 1.992 |
| (16) | TX Group AG | Goldman Sachs | (7) | (21.792) | Assura Plc (REIT) | Morgan Stanley | 2.569 |
| (818) | UBS Group AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 87 | (22.676) | Assura Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.039 |
| (1.212) | UBS Group AG Reg | Goldman Sachs | 99 | (70) | AstraZeneca Plc | Goldman Sachs | 1.081 |
| (1.360) | UBS Group AG Reg | Morgan Stanley | 1.215 | (76) | AstraZeneca Plc | Bank of America Merrill Lynch | 281 |
| 21 | Valiant Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (188) | (492) | Atalaya Mining Plc | Morgan Stanley | 339 |
| 15 | Valiant Holding AG Reg | Goldman Sachs | (111) | (430) | Auction Technology Group Plc | Goldman Sachs | 185 |
| 74 | VAT Group AG | Goldman Sachs | 4.468 | 5.712 | Auto Trader Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (127) |
| 129 | VAT Group AG | Morgan Stanley | 5.951 | 3.238 | Auto Trader Group Plc | Goldman Sachs | (72) |
| 200 | Vetropack Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | (394) | 3.098 | Auto Trader Group Plc | Morgan Stanley | (176) |
| 185 | Vetropack Holding AG Reg | Goldman Sachs | (365) | 2.687 | B&M European Value Retail SA | Morgan Stanley | 625 |
| (289) | Vontobel Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 665 | 2.883 | Babcock International Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (193) |
| (246) | Vontobel Holding AG Reg | Goldman Sachs | 566 | 6.775 | Babcock International Group Plc | Goldman Sachs | (453) |
| 29 | Ypsomed Holding AG Reg | Bank of America Merrill Lynch | 64 | 17.739 | Balanced Commercial Property Trust Ltd (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 5 |
| 136 | Ypsomed Holding AG Reg | Goldman Sachs | 298 | 16.389 | Balanced Commercial Property Trust Ltd (REIT) | Goldman Sachs | 4 |
| (34) | Zehnder Group AG | Bank of America Merrill Lynch | 82 | (3.793) | Balfour Beatty Plc | Goldman Sachs | 1.117 |
| (138) | Zehnder Group AG | Goldman Sachs | 333 | 927 | Bank of Georgia Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (3.321) |
| (87) | Zurich Insurance Group AG | Goldman Sachs | (353) | 1.541 | Bank of Georgia Group Plc | Goldman Sachs | (5.838) |
| (204) | Zurich Insurance Group AG | Morgan Stanley | (1.207) | (2.782) | Barratt Developments Plc | Goldman Sachs | 1.367 |
| | | | 32.578 | (6.717) | Barratt Developments Plc | Morgan Stanley | 3.002 |
| | | | | (1.422) | Berkeley Group Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | 7.182 |
| | | | | (1.343) | Berkeley Group Holdings Plc | Goldman Sachs | 6.783 |
| | | | | (349) | Berkeley Group Holdings Plc | Morgan Stanley | 1.335 |
| | | | | 1.983 | Big Yellow Group Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (655) |
| | | | | 1.746 | Big Yellow Group Plc (REIT) | Goldman Sachs | (631) |
| | | | | (849) | Bodycote Plc | Bank of America Merrill Lynch | 367 |
| | | | | (1.314) | Bodycote Plc | Goldman Sachs | 569 |
| | | | | 15.875 | boohoo Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 218 |
| | | | | 23.771 | boohoo Group Plc | Goldman Sachs | 73 |
| | | | | 8.538 | British Land Co Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (3.393) |
| | | | | 7.304 | British Land Co Plc (REIT) | Goldman Sachs | (2.902) |
| | | | | 5.636 | British Land Co Plc (REIT) | Morgan Stanley | (935) |
| | | | | (5.269) | BT Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 339 |
| | | | | (3.660) | BT Group Plc | Goldman Sachs | 236 |
| | | | | (1.552) | BT Group Plc | Morgan Stanley | (13) |
| | | | | 101 | Bunzl Plc | Bank of America Merrill Lynch | 7 |
| | | | | 694 | Bunzl Plc | Goldman Sachs | 52 |
| | | | | 611 | Bunzl Plc | Morgan Stanley | 197 |
| | | | | 1.607 | Burberry Group Plc | Morgan Stanley | (3.581) |
| | | | | 519 | Burford Capital Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (167) |
| | | | | 636 | Burford Capital Ltd | Goldman Sachs | (204) |
| | | | | 5.248 | Bytes Technology Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 5.262 |
| | | | | 11.040 | Bytes Technology Group Plc | Goldman Sachs | 11.826 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|------------------------------|-----------------|---|-----------------------------------|---------------------------|-----------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (3.960) | C&C Group Plc | Bank of America | | 59 | Diploma Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 402 | | | Merrill Lynch | 110 |
| (30.459) | C&C Group Plc | Goldman Sachs | 3.028 | 68 | Diploma Plc | Goldman Sachs | 126 |
| (7.564) | Capita Plc | Bank of America | | 62 | Diploma Plc | Morgan Stanley | 3 |
| | | Merrill Lynch | (242) | 1.225 | DiscoverIE Group Plc | Bank of America | |
| (14.131) | Capita Plc | Goldman Sachs | (451) | | | Merrill Lynch | 571 |
| (1.401) | Capricorn Energy Plc | Goldman Sachs | 13 | 1.847 | DiscoverIE Group Plc | Goldman Sachs | 745 |
| 492 | Carnival Plc | Goldman Sachs | 493 | 2.414 | Diversified Energy Co Plc | Bank of America | |
| 9.823 | Carnival Plc | Morgan Stanley | 1.532 | | | Merrill Lynch | (155) |
| 16.035 | Centamin Plc | Bank of America | | 6.059 | Diversified Energy Co Plc | Goldman Sachs | (390) |
| | | Merrill Lynch | (1.388) | (3.656) | Domino's Pizza Group Plc | Bank of America | |
| 34.100 | Centamin Plc | Goldman Sachs | (3.516) | | | Merrill Lynch | 646 |
| 16.568 | Centrica Plc | Bank of America | | (17.692) | Domino's Pizza Group Plc | Goldman Sachs | 3.053 |
| | | Merrill Lynch | 338 | (2.525) | Dr Martens Plc | Bank of America | |
| 40.051 | Centrica Plc | Goldman Sachs | 818 | | | Merrill Lynch | 366 |
| 34.460 | Centrica Plc | Morgan Stanley | 619 | (4.292) | Dr Martens Plc | Goldman Sachs | 606 |
| (1.788) | Ceres Power Holdings Plc | Goldman Sachs | 1.083 | 9.904 | Drax Group Plc | Morgan Stanley | (6.915) |
| 2.341 | Chemring Group Plc | Bank of America | | 1.439 | Dunelm Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (623) | | | Merrill Lynch | (1.015) |
| 7.458 | Chemring Group Plc | Goldman Sachs | (1.985) | 3.030 | Dunelm Group Plc | Goldman Sachs | (2.138) |
| 258 | Clarkson Plc | Bank of America | | 3.015 | easyJet Plc | Goldman Sachs | (694) |
| | | Merrill Lynch | (415) | 5.672 | easyJet Plc | Morgan Stanley | (1.819) |
| 27 | Clarkson Plc | Goldman Sachs | (43) | (2.861) | Elementis Plc | Bank of America | |
| 2.055 | Close Brothers Group Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 283 |
| | | Merrill Lynch | (216) | (16.193) | Elementis Plc | Goldman Sachs | 1.779 |
| 1.199 | Close Brothers Group Plc | Goldman Sachs | (126) | (561) | EMIS Group Plc | Bank of America | |
| (16.781) | Coats Group Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.514 |
| | | Merrill Lynch | 517 | (1.082) | EMIS Group Plc | Goldman Sachs | 2.920 |
| (34.699) | Coats Group Plc | Goldman Sachs | 1.160 | (2.639) | Energiean Plc | Bank of America | |
| (941) | Coca-Cola HBC AG | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 3.267 |
| | | Merrill Lynch | 1.782 | (2.615) | Energiean Plc | Goldman Sachs | 3.237 |
| (211) | Coca-Cola HBC AG | Goldman Sachs | 400 | (353) | Entain Plc | Goldman Sachs | 625 |
| (1.808) | Coca-Cola HBC AG | Morgan Stanley | 2.865 | (4.619) | Entain Plc | Morgan Stanley | 8.748 |
| (1.025) | Compass Group Plc | Bank of America | | (70) | Ergomed Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (609) | | | Merrill Lynch | 36 |
| (2.643) | Compass Group Plc | Goldman Sachs | (1.570) | 472 | Experian Plc | Bank of America | |
| (429) | Computacenter Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 672 |
| | | Merrill Lynch | 605 | 758 | Experian Plc | Goldman Sachs | 1.079 |
| (1.676) | Computacenter Plc | Goldman Sachs | 2.365 | 1.265 | Experian Plc | Morgan Stanley | 360 |
| 5.673 | ConvaTec Group Plc | Bank of America | | (55) | FD Technologies Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.081) | | | Merrill Lynch | (25) |
| 6.436 | ConvaTec Group Plc | Goldman Sachs | (1.227) | (102) | FD Technologies Plc | Goldman Sachs | (44) |
| 15.859 | ConvaTec Group Plc | Morgan Stanley | (3.337) | (658) | Ferguson Plc | Bank of America | |
| (33) | Craneware Plc | Goldman Sachs | 112 | | | Merrill Lynch | (285) |
| 296 | Cranswick Plc | Bank of America | | (106) | Ferguson Plc | Goldman Sachs | (46) |
| | | Merrill Lynch | 271 | (36) | Fevertree Drinks Plc | Goldman Sachs | 33 |
| 909 | Cranswick Plc | Goldman Sachs | 833 | 4.728 | Filtrona Plc | Bank of America | |
| (3.695) | Crest Nicholson Holdings Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (749) |
| | | Merrill Lynch | 897 | 2.622 | Filtrona Plc | Goldman Sachs | (415) |
| (1.355) | Crest Nicholson Holdings Plc | Goldman Sachs | 329 | 474 | Firstgroup Plc | Bank of America | |
| 179 | Croda International Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (22) |
| | | Merrill Lynch | (1.520) | 1.793 | Firstgroup Plc | Goldman Sachs | 2 |
| 179 | Croda International Plc | Goldman Sachs | (1.520) | 1.728 | Forterra Plc | Bank of America | |
| 389 | Croda International Plc | Morgan Stanley | (1.310) | | | Merrill Lynch | (171) |
| 5.907 | Currys Plc | Bank of America | | 1.187 | Forterra Plc | Goldman Sachs | (117) |
| | | Merrill Lynch | (323) | 2.327 | Frasers Group Plc | Bank of America | |
| 4.431 | Currys Plc | Goldman Sachs | (170) | | | Merrill Lynch | (2.724) |
| 1.251 | CVS Group Plc | Goldman Sachs | (960) | 2.920 | Frasers Group Plc | Goldman Sachs | (3.555) |
| (2.850) | DCC Plc | Morgan Stanley | 14.571 | (2.024) | Future Plc | Goldman Sachs | 1.088 |
| (135) | Dechra Pharmaceuticals Plc | Goldman Sachs | 545 | 571 | Gamma | Bank of America | |
| 5.348 | Deliveroo Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | — |
| | | Merrill Lynch | (10) | 499 | Gamma | Bank of America | |
| 2.479 | Deliveroo Plc | Goldman Sachs | (10) | | | Goldman Sachs | — |
| (259) | Derwent London Plc (REIT) | Bank of America | | (5.793) | GB Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 256 | | | Merrill Lynch | 703 |
| (1.296) | Derwent London Plc (REIT) | Goldman Sachs | 1.156 | (3.856) | GB Group Plc | Goldman Sachs | 468 |
| (482) | Derwent London Plc (REIT) | Morgan Stanley | 251 | (1.277) | Genuit Group Plc | Goldman Sachs | (85) |
| (91) | Diageo Plc | Bank of America | | (229) | Genus Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 135 | | | Merrill Lynch | (68) |
| | | | | (65) | Genus Plc | Goldman Sachs | (7) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|-----------------------------------|--|-------------------------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (2.233) | Glencore Plc | Bank of America Merrill Lynch | 652 | (2.298) | Impact Healthcare Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 119 |
| (2.153) | Glencore Plc | Goldman Sachs | 648 | (2.725) | Impact Healthcare Plc (REIT) | Goldman Sachs | 142 |
| (3.164) | Glencore Plc | Morgan Stanley | 850 | 758 | Impax Asset Management Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.295) |
| 702 | Grafton Group Plc (Unit) | Bank of America Merrill Lynch | (190) | 952 | Impax Asset Management Group Plc | Goldman Sachs | (1.626) |
| 480 | Grafton Group Plc (Unit) | Goldman Sachs | (165) | 2.616 | Inchcape Plc | Bank of America Merrill Lynch | (243) |
| 7.835 | Grainger Plc | Bank of America Merrill Lynch | (504) | 4.425 | Inchcape Plc | Goldman Sachs | (411) |
| 4.790 | Grainger Plc | Goldman Sachs | (308) | 1.791 | Inchcape Plc | Morgan Stanley | (732) |
| (3.577) | Great Portland Estates Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 633 | 1.044 | Indivior Plc | Bank of America Merrill Lynch | (168) |
| (2.545) | Great Portland Estates Plc (REIT) | Goldman Sachs | 466 | 2.682 | Indivior Plc | Morgan Stanley | (1.328) |
| (63.654) | Greatland Gold Plc | Bank of America Merrill Lynch | 832 | (8.405) | Informa Plc | Bank of America Merrill Lynch | (30) |
| (97.611) | Greatland Gold Plc | Goldman Sachs | 1.275 | (1.661) | Informa Plc | Goldman Sachs | (44) |
| (1.365) | Greencore Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 5 | (7.425) | Informa Plc | Morgan Stanley | 2.555 |
| (3.528) | Greencore Group Plc | Goldman Sachs | 13 | (1.349) | IntegraFin Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | 401 |
| (1.374) | Greggs Plc | Morgan Stanley | 510 | (995) | IntegraFin Holdings Plc | Goldman Sachs | 296 |
| (1.396) | GSK Plc | Morgan Stanley | 1.262 | 4.328 | Intermediate Capital Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 6.108 |
| (841) | Gulf Keystone Petroleum Ltd | Goldman Sachs | (14) | 4.060 | Intermediate Capital Group Plc | Goldman Sachs | 5.729 |
| (4.535) | Haleon Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.426 | 1.178 | Intermediate Capital Group Plc | Morgan Stanley | 532 |
| (531) | Haleon Plc | Goldman Sachs | 167 | (10.542) | International Consolidated Airlines Group SA | Bank of America Merrill Lynch | (144) |
| (20.735) | Haleon Plc | Morgan Stanley | 4.928 | (13.255) | International Consolidated Airlines Group SA | Goldman Sachs | (181) |
| (1.725) | Halfords Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (68) | (12.213) | International Consolidated Airlines Group SA | Morgan Stanley | 499 |
| (5.471) | Halfords Group Plc | Goldman Sachs | (217) | (8.601) | International Distributions Services Plc | Bank of America Merrill Lynch | 3.386 |
| 448 | Halma Plc | Bank of America Merrill Lynch | (277) | (9.713) | International Distributions Services Plc | Goldman Sachs | 3.824 |
| 135 | Halma Plc | Morgan Stanley | (75) | (5.288) | International Distributions Services Plc | Morgan Stanley | 301 |
| 56.533 | Hammerson Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (910) | (1.876) | Investec Plc | Bank of America Merrill Lynch | 799 |
| 7 | Hammerson Plc (REIT) ^{††} | Morgan Stanley | — | (5.156) | Investec Plc | Goldman Sachs | 2.196 |
| (2.967) | Harbour Energy Plc | Bank of America Merrill Lynch | 595 | (1.607) | Investec Plc | Morgan Stanley | 732 |
| (4.632) | Harbour Energy Plc | Morgan Stanley | 648 | (2) | IP Group Plc ^{††} | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (25.986) | Hays Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.512 | (5) | IP Group Plc ^{††} | Goldman Sachs | — |
| (23.258) | Hays Plc | Goldman Sachs | 1.353 | 25.733 | ITV Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.695) |
| 250 | Hill & Smith Plc | Bank of America Merrill Lynch | (487) | 80.563 | ITV Plc | Goldman Sachs | (5.306) |
| 235 | Hill & Smith Plc | Goldman Sachs | 442 | 63.174 | ITV Plc | Morgan Stanley | (3.832) |
| 7.635 | Hochschild Mining Plc | Bank of America Merrill Lynch | (399) | 9.315 | J Sainsbury Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.677) |
| 6.252 | Hochschild Mining Plc | Goldman Sachs | (399) | 1.324 | J Sainsbury Plc | Morgan Stanley | (64) |
| (7.874) | Home Plc (REIT) [*] | Bank of America Merrill Lynch | (3.282) | (16.943) | JD Sports Fashion Plc | Morgan Stanley | 1.688 |
| (12.625) | Home Plc (REIT) [*] | Goldman Sachs | 683 | 285 | JD Wetherspoon Plc | Bank of America Merrill Lynch | 79 |
| (11.640) | HSBC Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2.518 | 416 | JD Wetherspoon Plc | Goldman Sachs | 119 |
| (10.068) | HSBC Holdings Plc | Goldman Sachs | 2.240 | (571) | JET2 Plc | Bank of America Merrill Lynch | 297 |
| (23.352) | HSBC Holdings Plc | Morgan Stanley | 6.938 | (209) | JET2 Plc | Goldman Sachs | 109 |
| 619 | Hunting Plc | Bank of America Merrill Lynch | 100 | 6.545 | John Wood Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 346 |
| 3.465 | Hunting Plc | Goldman Sachs | 558 | 8.539 | John Wood Group Plc | Goldman Sachs | 167 |
| 3.888 | Ibstock Plc | Bank of America Merrill Lynch | (264) | (1.282) | Johnson Matthey Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2.969 |
| 9.566 | Ibstock Plc | Goldman Sachs | (649) | (1.012) | Johnson Matthey Plc | Goldman Sachs | 2.118 |
| 692 | IG Group Holdings Plc | Goldman Sachs | (244) | (118) | Johnson Matthey Plc | Morgan Stanley | 96 |
| 985 | IG Group Holdings Plc | Morgan Stanley | (287) | | | | |
| 1.325 | IMI Plc | Bank of America Merrill Lynch | (410) | | | | |
| 3.487 | IMI Plc | Goldman Sachs | (1.079) | | | | |
| 2.313 | IMI Plc | Morgan Stanley | (1.632) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---|-----------------------------------|---|-------------------------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| 5.639 | Johnson Service Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (977) | 2.453 | Mitchells & Butlers Plc | Bank of America Merrill Lynch | 238 |
| 4.843 | Johnson Service Group Plc | Goldman Sachs | (839) | 793 | Mitchells & Butlers Plc | Goldman Sachs | 90 |
| 1.252 | JTC Plc | Bank of America Merrill Lynch | (899) | (16.559) | Mitie Group Plc | Goldman Sachs | 799 |
| 1.138 | JTC Plc | Goldman Sachs | (817) | (2.590) | Molten Ventures Plc | Bank of America Merrill Lynch | (821) |
| 39 | Judges Scientific Plc | Bank of America Merrill Lynch | (40) | (2.965) | Molten Ventures Plc | Goldman Sachs | (940) |
| 87 | Judges Scientific Plc | Goldman Sachs | (88) | (1.556) | Mondi Plc | Bank of America Merrill Lynch | 803 |
| 7.246 | Jupiter Fund Management Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.139) | (1.267) | Mondi Plc | Goldman Sachs | 655 |
| 4.009 | Jupiter Fund Management Plc | Goldman Sachs | (630) | (2.199) | Mondi Plc | Morgan Stanley | 1.136 |
| 16.811 | Just Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (520) | 5.974 | Moneysupermarket.com Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (836) |
| 11.241 | Just Group Plc | Goldman Sachs | (348) | 6.531 | Moneysupermarket.com Group Plc | Goldman Sachs | (1.098) |
| 2.329 | Kainos Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2.267 | 2 | Moneysupermarket.com Group Plc [†] | Morgan Stanley | — |
| 2.762 | Kainos Group Plc | Goldman Sachs | 2.701 | (5.152) | Moonpig Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (16) |
| (1.103) | Keller Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (822) | (828) | Moonpig Group Plc [†] | Goldman Sachs | — |
| (171) | Keller Group Plc | Goldman Sachs | (127) | 2.656 | Morgan Crucible Co Plc | Bank of America Merrill Lynch | 247 |
| 228 | Keywords Studios Plc | Bank of America Merrill Lynch | (948) | 4.439 | Morgan Crucible Co Plc | Goldman Sachs | 412 |
| 302 | Keywords Studios Plc | Goldman Sachs | (1.196) | 342 | Morgan Sindall Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (85) |
| 2.585 | Lancashire Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 288 | 535 | Morgan Sindall Group Plc | Goldman Sachs | (132) |
| 4.040 | Lancashire Holdings Ltd | Goldman Sachs | 450 | 9.339 | National Express Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.364) |
| 1.152 | Land Securities Group Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (257) | 13.713 | National Express Group Plc | Goldman Sachs | (2.003) |
| 1.085 | Land Securities Group Plc (REIT) | Goldman Sachs | (242) | (1.726) | National Grid Plc | Bank of America Merrill Lynch | 1.143 |
| 967 | Land Securities Group Plc (REIT) | Morgan Stanley | (352) | (4.029) | National Grid Plc | Goldman Sachs | 2.668 |
| 3.553 | Learning Technologies Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 3 | (1.506) | National Grid Plc | Morgan Stanley | (37) |
| 4.375 | Learning Technologies Group Plc | Goldman Sachs | 4 | (6.939) | NCC Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 739 |
| (363) | Liontrust Asset Management Plc | Bank of America Merrill Lynch | 71 | (10.828) | NCC Group Plc | Goldman Sachs | 1.153 |
| (757) | Liontrust Asset Management Plc | Goldman Sachs | 293 | (1.826) | Network International Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | 81 |
| (2.577) | Lloyds Banking Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 55 | (8.517) | Network International Holdings Plc | Goldman Sachs | 352 |
| (55.087) | Lloyds Banking Group Plc | Goldman Sachs | 1.183 | (190) | Next 15 Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 129 |
| (3.301) | Lloyds Banking Group Plc | Morgan Stanley | 98 | (407) | Next 15 Group Plc | Goldman Sachs | 277 |
| 230 | London Stock Exchange Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | 256 | (1.225) | Ocado Group Plc | Goldman Sachs | 910 |
| 433 | London Stock Exchange Group Plc | Goldman Sachs | 463 | (1.045) | Ocado Group Plc | Morgan Stanley | 419 |
| 562 | London Stock Exchange Group Plc | Morgan Stanley | 515 | 3.696 | OSB Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (352) |
| 5.323 | LondonMetric Property Plc (REIT) | Goldman Sachs | (165) | 3.567 | OSB Group Plc | Goldman Sachs | (155) |
| (11.286) | LXI Plc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 908 | (158) | Oxford Biomedica Plc | Bank of America Merrill Lynch | (16) |
| (42.014) | LXI Plc (REIT) | Goldman Sachs | 3.381 | (654) | Oxford Biomedica Plc | Goldman Sachs | (300) |
| (20.326) | M&G Plc | Bank of America Merrill Lynch | (176) | 308 | Oxford Instruments Plc | Bank of America Merrill Lynch | (199) |
| (15.800) | M&G Plc | Goldman Sachs | (137) | 96 | Oxford Instruments Plc | Goldman Sachs | (121) |
| (21.189) | M&G Plc | Morgan Stanley | 52 | (1.435) | Oxford Nanopore Technologies Plc | Goldman Sachs | (61) |
| (496) | Marlowe Plc | Bank of America Merrill Lynch | (43) | 3.257 | Paragon Group of Cos Plc | Bank of America Merrill Lynch | (562) |
| (1.572) | Marlowe Plc | Goldman Sachs | (136) | 3.126 | Paragon Group of Cos Plc | Goldman Sachs | (472) |
| 1.040 | Marshalls Plc | Bank of America Merrill Lynch | 118 | 2.655 | Pennon Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.514) |
| 1.542 | Marshalls Plc | Goldman Sachs | 176 | 3.384 | Pennon Group Plc | Goldman Sachs | (3.205) |
| (5.414) | Michael Page International Plc | Bank of America Merrill Lynch | 415 | 895 | Pennon Group Plc | Morgan Stanley | (510) |
| (6.866) | Michael Page International Plc | Goldman Sachs | 527 | (1.721) | Persimmon Plc | Bank of America Merrill Lynch | 2.844 |
| | | | | (1.325) | Persimmon Plc | Goldman Sachs | 2.190 |
| | | | | (1.636) | Persimmon Plc | Morgan Stanley | 2.126 |
| | | | | (750) | Petrofac Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 4 |
| | | | | (22.295) | Petrofac Ltd | Goldman Sachs | (248) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|-----------------------------|-----------------|---|-----------------------------------|--------------------------------|-----------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (516) | Pets at Home Group Plc | Bank of America | | 6.089 | Rotork Plc | Goldman Sachs | (709) |
| | | Merrill Lynch | 101 | 7.155 | Rotork Plc | Morgan Stanley | (1.647) |
| (816) | Pets at Home Group Plc | Goldman Sachs | 160 | 708 | RWS Holdings Plc | Bank of America | |
| 2.570 | Phoenix Group Holdings Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (175) |
| | | Merrill Lynch | (464) | 1.764 | RWS Holdings Plc | Goldman Sachs | (437) |
| 4.727 | Phoenix Group Holdings Plc | Goldman Sachs | (854) | (5.773) | S4 Capital Plc | Bank of America | |
| 2.964 | Phoenix Group Holdings Plc | Morgan Stanley | (734) | | | Merrill Lynch | 871 |
| (633) | Playtech Plc | Bank of America | | (7.018) | S4 Capital Plc | Goldman Sachs | 1.207 |
| | | Merrill Lynch | 74 | 1.092 | Safestore Holdings Plc (REIT) | Bank of America | |
| (875) | Playtech Plc | Goldman Sachs | 90 | | | Merrill Lynch | (135) |
| (1.300) | Plus500 Ltd | Bank of America | | 818 | Safestore Holdings Plc (REIT) | Goldman Sachs | (47) |
| | | Merrill Lynch | 549 | (672) | Sage Group Plc | Bank of America | |
| (431) | Plus500 Ltd | Goldman Sachs | 63 | | | Merrill Lynch | (487) |
| 573 | Polar Capital Holdings Plc | Bank of America | | (488) | Sage Group Plc | Goldman Sachs | (354) |
| | | Merrill Lynch | 170 | 482 | Savills Plc | Bank of America | |
| 1.196 | Polar Capital Holdings Plc | Goldman Sachs | 355 | | | Merrill Lynch | (176) |
| 3.822 | Premier Foods Plc | Bank of America | | 512 | Savills Plc | Goldman Sachs | (187) |
| | | Merrill Lynch | 178 | 2.176 | Segro Plc (REIT) | Goldman Sachs | (555) |
| 2.114 | Premier Foods Plc | Goldman Sachs | 50 | 10.981 | Segro Plc (REIT) | Morgan Stanley | (2.039) |
| (1.104) | PRS Plc (REIT) | Bank of America | | 210 | Serica Energy Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 19 | | | Merrill Lynch | (51) |
| (4.740) | PRS Plc (REIT) | Goldman Sachs | 82 | (6.176) | Shaftesbury Capital Plc (REIT) | Bank of America | |
| (2.312) | Prudential Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 74 |
| | | Merrill Lynch | 3.048 | (14.064) | Shaftesbury Capital Plc (REIT) | Goldman Sachs | (42) |
| (3.295) | Prudential Plc | Goldman Sachs | 4.344 | 1.351 | SIG Plc | Bank of America | |
| (10.690) | Prudential Plc | Morgan Stanley | 15.681 | | | Merrill Lynch | (43) |
| 3.045 | PZ Cussons Plc | Bank of America | | 24.225 | SIG Plc | Goldman Sachs | (765) |
| | | Merrill Lynch | (400) | (10.530) | Sirius Real Estate Ltd | Bank of America | |
| 4.052 | PZ Cussons Plc | Goldman Sachs | (532) | | | Merrill Lynch | (254) |
| 6.412 | QinetiQ Group Plc | Bank of America | | (16.483) | Sirius Real Estate Ltd | Goldman Sachs | (398) |
| | | Merrill Lynch | (968) | 1.102 | Smart Metering Systems Plc | Bank of America | |
| 8.572 | QinetiQ Group Plc | Goldman Sachs | (1.294) | | | Merrill Lynch | (468) |
| 20.030 | Quilter Plc | Bank of America | | 2.150 | Smart Metering Systems Plc | Goldman Sachs | (913) |
| | | Merrill Lynch | (285) | (1.651) | Smith & Nephew Plc | Bank of America | |
| 18.123 | Quilter Plc | Goldman Sachs | (258) | | | Merrill Lynch | 1.666 |
| (818) | Rank Group Plc | Bank of America | | (3.726) | Smith & Nephew Plc | Goldman Sachs | 3.759 |
| | | Merrill Lynch | 20 | (1.817) | Smith & Nephew Plc | Morgan Stanley | 1.743 |
| (2.128) | Rank Group Plc | Goldman Sachs | 53 | 550 | Smiths Group Plc | Bank of America | |
| (983) | Rathbone Brothers Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (249) |
| | | Merrill Lynch | (1.010) | 410 | Smiths Group Plc | Goldman Sachs | (185) |
| (368) | Rathbone Brothers Plc | Goldman Sachs | (395) | 336 | Smiths Group Plc | Morgan Stanley | (275) |
| (126) | Reckitt Benckiser Group Plc | Morgan Stanley | 148 | 1.881 | Softcat Plc | Goldman Sachs | 955 |
| 4.989 | Redde Northgate Plc | Bank of America | | (8.030) | SolGold Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (772) | | | Merrill Lynch | 27 |
| 1.960 | Redde Northgate Plc | Goldman Sachs | (340) | 1.584 | Spectris Plc | Bank of America | |
| 1.584 | Redrow Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.451) |
| | | Merrill Lynch | (969) | 1.802 | Spectris Plc | Goldman Sachs | (2.788) |
| 678 | Redrow Plc | Goldman Sachs | (415) | 395 | Spectris Plc | Morgan Stanley | (597) |
| (2.278) | RELX Plc | Morgan Stanley | (1.213) | 306 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Bank of America | |
| (909) | Renewi Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (474) |
| | | Merrill Lynch | 709 | 198 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Goldman Sachs | (306) |
| (2.920) | Renewi Plc | Goldman Sachs | 2.277 | 189 | Spirax-Sarco Engineering Plc | Morgan Stanley | (737) |
| 197 | Renishaw Plc | Bank of America | | 2.305 | Spire Healthcare Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 712 | | | Merrill Lynch | (414) |
| 90 | Renishaw Plc | Goldman Sachs | 325 | 5.099 | Spire Healthcare Group Plc | Goldman Sachs | (915) |
| 560 | Renishaw Plc | Morgan Stanley | 1.359 | (11.968) | Spirent Communications Plc | Bank of America | |
| (9.964) | Rentokil Initial Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (319) |
| | | Merrill Lynch | 691 | (6.185) | Spirent Communications Plc | Goldman Sachs | (161) |
| (10.635) | Rentokil Initial Plc | Goldman Sachs | 737 | (4.866) | SSP Group Plc | Bank of America | |
| (8.413) | Rentokil Initial Plc | Morgan Stanley | — | | | Merrill Lynch | (639) |
| 63 | RHI Magnesita NV | Bank of America | | (9.479) | SSP Group Plc | Goldman Sachs | (1.244) |
| | | Merrill Lynch | 273 | (976) | St James's Place Plc | Bank of America | |
| 29 | RHI Magnesita NV | Goldman Sachs | 165 | | | Merrill Lynch | 109 |
| 3.723 | Rightmove Plc | Bank of America | | (1.979) | St James's Place Plc | Goldman Sachs | 220 |
| | | Merrill Lynch | (1.761) | (325) | St James's Place Plc | Morgan Stanley | 127 |
| 8.345 | Rightmove Plc | Goldman Sachs | (3.946) | 2.335 | SThree Plc | Goldman Sachs | (708) |
| 2.386 | Rightmove Plc | Morgan Stanley | (1.016) | | | | |
| 2.778 | Rio Tinto Plc | Morgan Stanley | (4.350) | | | | |
| 3.194 | Rotork Plc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (372) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------|---|---------------------------------------|----------------------------------|-----------------|---|
| Großbritannien Fortsetzung | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | |
| (12.157) | Supermarket Income Plc (REIT) | Goldman Sachs | 1.111 | (6.357) | Vistry Group Plc | Goldman Sachs | 5.351 |
| (4.179) | Synthomer Plc | Bank of America | | (2.077) | Vistry Group Plc | Morgan Stanley | 2.031 |
| | | Merrill Lynch | 824 | (6.926) | Volex Plc | Bank of America | |
| (6.183) | Synthomer Plc | Goldman Sachs | 1.688 | (507) | Volex Plc | Merrill Lynch | 1.007 |
| 6.848 | Taylor Wimpey Plc | Bank of America | | 1.673 | Volution Group Plc | Goldman Sachs | 74 |
| | | Merrill Lynch | (1.017) | | | Bank of America | |
| 3.725 | Taylor Wimpey Plc | Goldman Sachs | (553) | 2.991 | Volution Group Plc | Merrill Lynch | 290 |
| 14.320 | Taylor Wimpey Plc | Morgan Stanley | (1.888) | (1.474) | Watches of Switzerland Group Plc | Goldman Sachs | 518 |
| 478 | TBC Bank Group Plc | Bank of America | | (1.157) | Watches of Switzerland Group Plc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (554) | | | Merrill Lynch | 1.533 |
| 1.215 | TBC Bank Group Plc | Goldman Sachs | (1.559) | (170) | Watches of Switzerland Group Plc | Goldman Sachs | 1.203 |
| 473 | Telecom Plus Plc | Bank of America | | (905) | WH Smith Plc | Morgan Stanley | 28 |
| | | Merrill Lynch | (1.604) | | | Bank of America | |
| 716 | Telecom Plus Plc | Goldman Sachs | (2.429) | (2.215) | WH Smith Plc | Merrill Lynch | 911 |
| (2.599) | THG Plc | Bank of America | | (1.876) | Whitbread Plc | Goldman Sachs | 2.235 |
| | | Merrill Lynch | 14 | (231) | Wickes Group Plc | Morgan Stanley | 418 |
| (8.467) | THG Plc | Goldman Sachs | 45 | | | Bank of America | |
| (5.040) | TI Fluid Systems Plc | Bank of America | | (1.538) | Wincanton Plc | Merrill Lynch | 38 |
| | | Merrill Lynch | 409 | | | Bank of America | |
| (7.312) | TI Fluid Systems Plc | Goldman Sachs | 606 | (1.924) | Wincanton Plc | Merrill Lynch | (657) |
| 8.540 | TP ICAP Group Plc | Bank of America | | (853) | Workspace Group Plc (REIT) | Goldman Sachs | (822) |
| | | Merrill Lynch | (1.808) | | | Bank of America | |
| 10.014 | TP ICAP Group Plc | Goldman Sachs | (1.812) | (809) | Workspace Group Plc (REIT) | Merrill Lynch | (301) |
| 716 | Trainline Plc | Bank of America | | (5.851) | Yellow Cake Plc | Goldman Sachs | (285) |
| | | Merrill Lynch | (291) | | | Bank of America | |
| 2.746 | Trainline Plc | Goldman Sachs | (1.115) | (13.585) | Yellow Cake Plc | Merrill Lynch | 869 |
| 1.919 | Travis Perkins Plc | Bank of America | | 787 | YouGov Plc | Goldman Sachs | 2.018 |
| | | Merrill Lynch | (1.121) | | | Bank of America | |
| 2.828 | Travis Perkins Plc | Goldman Sachs | (1.652) | 692 | YouGov Plc | Merrill Lynch | 1.315 |
| 5.360 | Travis Perkins Plc | Morgan Stanley | (2.548) | | | Goldman Sachs | 1.156 |
| (14.249) | Trinity Mirror Plc | Bank of America | | | | | 100.791 |
| | | Merrill Lynch | 1.225 | Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| (12.362) | Trinity Mirror Plc | Goldman Sachs | 1.102 | (85) | 10X Genomics Inc 'A' | Bank of America | |
| 9.491 | Tritax Big Box Plc (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 50 |
| | | Merrill Lynch | (846) | (84) | 10X Genomics Inc 'A' | Goldman Sachs | 50 |
| 3.107 | Tritax Big Box Plc (REIT) | Goldman Sachs | (277) | (48) | 10X Genomics Inc 'A' | Morgan Stanley | 186 |
| 15.743 | Tritax Big Box Plc (REIT) | Morgan Stanley | (565) | 157 | 1st Source Corp | Bank of America | |
| 198 | TUI AG | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 82 |
| | | Merrill Lynch | (33) | 144 | 1st Source Corp | Goldman Sachs | 75 |
| (136.095) | Tullow Oil Plc | Goldman Sachs | (2.442) | 445 | 2U Inc | Bank of America | |
| (1.881) | Tyman Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (36) |
| | | Merrill Lynch | (270) | 1.463 | 2U Inc | Goldman Sachs | (117) |
| (1.406) | Tyman Plc | Goldman Sachs | (170) | (2.852) | 3D Systems Corp | Bank of America | |
| 10.590 | UK Commercial Property Ltd (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 599 |
| 55.273 | UK Commercial Property Ltd (REIT) | Merrill Lynch | (251) | (2.558) | 3D Systems Corp | Goldman Sachs | 286 |
| (524) | Unilever Plc | Goldman Sachs | (1.310) | (425) | 4D Molecular Therapeutics Inc | Bank of America | |
| | | Bank of America | 773 | | | Merrill Lynch | (427) |
| (1.179) | Unilever Plc | Merrill Lynch | 3.892 | (258) | 4D Molecular Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (269) |
| 3.132 | United Utilities Group Plc | Bank of America | | 567 | 8x8 Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.822) | | | Merrill Lynch | 408 |
| 5.596 | United Utilities Group Plc | Goldman Sachs | (3.256) | 5.895 | 8x8 Inc | Goldman Sachs | 4.244 |
| 4.030 | United Utilities Group Plc | Morgan Stanley | (574) | 30 | A O Smith Corp | Morgan Stanley | (91) |
| (2.248) | Urban Logistics Plc (REIT) | Bank of America | | 2.453 | A10 Networks Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 33 | | | Merrill Lynch | 2.220 |
| (5.045) | Urban Logistics Plc (REIT) | Goldman Sachs | 75 | 1.702 | A10 Networks Inc | Goldman Sachs | 1.540 |
| (146) | Vanquis Banking Group Plc | Bank of America | 5 | 67 | AAON Inc | Goldman Sachs | (489) |
| 1.222 | Vesuvius Plc | Merrill Lynch | 239 | (235) | AAR Corp | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | 1.175 | | | Merrill Lynch | 533 |
| 6.009 | Vesuvius Plc | Bank of America | | (298) | AAR Corp | Goldman Sachs | 676 |
| 224 | Victrex Plc | Merrill Lynch | 80 | 566 | Aaron's Co Inc | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | 44 | | | Merrill Lynch | (192) |
| 122 | Victrex Plc | Bank of America | | 165 | Aaron's Co Inc | Goldman Sachs | (56) |
| 14.646 | Virgin Money UK Plc | Merrill Lynch | (961) | 245 | AbCellera Biologics Inc | Morgan Stanley | 91 |
| | | Goldman Sachs | (1.476) | 504 | Abercrombie & Fitch Co 'A' | Bank of America | |
| 22.493 | Virgin Money UK Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 3.478 |
| (7.147) | Vistry Group Plc | Merrill Lynch | 6.016 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|----------------------------------|---|---|----------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.060 | Abercrombie & Fitch Co 'A' | Goldman Sachs | 7.314 | (122) | Aerovate Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 587 |
| (322) | ABM Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (245) | (133) | AeroVironment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.440 |
| (971) | ABM Industries Inc | Goldman Sachs | (738) | (145) | AeroVironment Inc | Goldman Sachs | 1.583 |
| 48 | Academy Sports & Outdoors Inc | Goldman Sachs | (531) | (734) | AerSale Corp | Goldman Sachs | 543 |
| 274 | Acadia Healthcare Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (891) | (1.324) | AES Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.032 |
| 144 | Acadia Healthcare Co Inc | Goldman Sachs | (468) | (186) | AES Corp | Goldman Sachs | 426 |
| 168 | Acadia Healthcare Co Inc | Morgan Stanley | (677) | (342) | AES Corp | Morgan Stanley | 499 |
| (222) | ACADIA Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (446) | (3.405) | Aeva Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (375) |
| (758) | Acadia Realty Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 457 | (925) | Aeva Technologies Inc | Goldman Sachs | (102) |
| (529) | Acadia Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 349 | 44 | Affiliated Managers Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (101) |
| 462 | Accel Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | (125) | 113 | Affiliated Managers Group Inc | Goldman Sachs | (260) |
| 1.314 | Accel Entertainment Inc | Goldman Sachs | (355) | 106 | Affiliated Managers Group Inc | Morgan Stanley | (261) |
| (420) | Accenture Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (7.023) | (520) | Affirm Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.355) |
| (264) | Accenture Plc 'A' | Goldman Sachs | (3.775) | (1.973) | Affirm Holdings Inc | Morgan Stanley | (1.726) |
| (117) | Accenture Plc 'A' | Morgan Stanley | (271) | (446) | Aflac Inc | Bank of America Merrill Lynch | 494 |
| (271) | ACCO Brands Corp | Bank of America Merrill Lynch | 68 | (688) | Aflac Inc | Goldman Sachs | 1.005 |
| (233) | ACCO Brands Corp | Goldman Sachs | 123 | (589) | Aflac Inc | Morgan Stanley | 846 |
| 530 | ACI Worldwide Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.085) | (362) | AGCO Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.474 |
| 1.083 | ACI Worldwide Inc | Goldman Sachs | (2.361) | (92) | AGCO Corp | Goldman Sachs | 1.137 |
| 72 | ACM Research Inc 'A' | Goldman Sachs | 11 | (127) | AGCO Corp | Morgan Stanley | 453 |
| (13) | Acuity Brands Inc | Goldman Sachs | 87 | 1.501 | Agilent Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (18.629) |
| 881 | Acushnet Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.824) | 285 | Agilent Technologies Inc | Goldman Sachs | (3.579) |
| 524 | Acushnet Holdings Corp | Goldman Sachs | (1.085) | 959 | Agilent Technologies Inc | Morgan Stanley | (12.080) |
| (1.700) | ACV Auctions Inc 'A' | Goldman Sachs | (476) | (1.021) | Agiliti Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.174) |
| (996) | AdaptHealth Corp | Bank of America Merrill Lynch | 697 | (776) | Agiliti Inc | Goldman Sachs | (892) |
| (1.497) | AdaptHealth Corp | Goldman Sachs | 1.048 | (1.303) | agilon health Inc | Goldman Sachs | 4.912 |
| 76 | Addus HomeCare Corp | Bank of America Merrill Lynch | (13) | (2.716) | agilon health Inc | Morgan Stanley | 2.716 |
| 37 | Addus HomeCare Corp | Goldman Sachs | (10) | (7) | Agilysys Inc | Bank of America Merrill Lynch | 31 |
| (2.456) | Adeia Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.179) | (88) | Agilysys Inc | Goldman Sachs | 392 |
| (1.022) | Adeia Inc | Goldman Sachs | (491) | 223 | Agios Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (127) |
| (57) | Adicet Bio Inc | Bank of America Merrill Lynch | 94 | 738 | Agios Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (421) |
| (16) | Adicet Bio Inc | Goldman Sachs | 26 | 804 | Air Transport Services Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 868 |
| 128 | Adobe Inc | Goldman Sachs | 8.913 | 221 | Air Transport Services Group Inc | Goldman Sachs | 239 |
| 265 | Adobe Inc | Morgan Stanley | 11.461 | (22) | Airbnb Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 56 |
| (762) | ADT Inc | Goldman Sachs | 110 | (217) | Airbnb Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.111 |
| (698) | Adtalem Global Education Inc | Bank of America Merrill Lynch | (857) | 268 | Akamai Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.758 |
| (539) | Adtalem Global Education Inc | Goldman Sachs | (803) | 78 | Akamai Technologies Inc | Goldman Sachs | 512 |
| (542) | ADTRAN Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (81) | 371 | Akamai Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.681 |
| (604) | ADTRAN Holdings Inc | Goldman Sachs | (91) | (724) | Akero Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 2.295 |
| 179 | Advanced Energy Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.919 | (55) | Alamo Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 362 |
| 772 | Advanced Energy Industries Inc | Goldman Sachs | 8.276 | (81) | Alamo Group Inc | Goldman Sachs | 680 |
| 484 | Advanced Micro Devices Inc | Morgan Stanley | 6.712 | 594 | Alarm.com Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 167 |
| 38 | AdvanSix Inc | Bank of America Merrill Lynch | (18) | 341 | Alarm.com Holdings Inc | Goldman Sachs | 95 |
| 296 | AdvanSix Inc | Goldman Sachs | (138) | 215 | Alaska Air Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 376 |
| 283 | AECOM | Bank of America Merrill Lynch | (563) | 171 | Alaska Air Group Inc | Goldman Sachs | 221 |
| 456 | AECOM | Morgan Stanley | (814) | 158 | Alaska Air Group Inc | Morgan Stanley | 14 |
| (959) | Aehr Test Systems | Bank of America Merrill Lynch | (4.862) | 560 | Albany International Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.906) |
| (294) | Aehr Test Systems | Goldman Sachs | (1.491) | 345 | Albany International Corp 'A' | Goldman Sachs | (1.791) |
| (240) | AerCap Holdings NV | Morgan Stanley | 317 | (41) | Albemarle Corp | Bank of America Merrill Lynch | 231 |
| | | | | (457) | Albemarle Corp | Goldman Sachs | 3.688 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------|-----------------|---|---|----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (316) | Albemarle Corp | Morgan Stanley | 2.569 | 95 | Alnylam | Bank of America | |
| (982) | Albertsons Cos Inc 'A' | Bank of America | | | Pharmaceuticals Inc | Merrill Lynch | (1.701) |
| | | Merrill Lynch | 49 | 30 | Alnylam | | |
| (3.441) | Albertsons Cos Inc 'A' | Morgan Stanley | 103 | | Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (537) |
| 1.297 | Alcoa Corp | Bank of America | | 118 | Alnylam | | |
| | | Merrill Lynch | (6.498) | | Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (563) |
| 117 | Alcoa Corp | Goldman Sachs | (586) | (61) | Alpha Metallurgical | Bank of America | |
| 1.342 | Alcoa Corp | Morgan Stanley | (5.782) | | Resources Inc | Merrill Lynch | 134 |
| 1.128 | Alector Inc | Bank of America | | 781 | Alphabet Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (259) | | | Merrill Lynch | 5.170 |
| 1.437 | Alector Inc | Goldman Sachs | (331) | 737 | Alphabet Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.879 |
| 520 | Alexander & Baldwin Inc | Bank of America | | 32 | Alphabet Inc 'A' | Morgan Stanley | (61) |
| | | Merrill Lynch | (187) | 116 | Alphabet Inc 'C' | Bank of America | |
| 425 | Alexander & Baldwin Inc | Goldman Sachs | (153) | | | Merrill Lynch | 655 |
| (52) | Alexander's Inc (REIT) | Bank of America | | 292 | Alphabet Inc 'C' | Goldman Sachs | 388 |
| | | Merrill Lynch | 330 | 302 | Alphabet Inc 'C' | Morgan Stanley | (493) |
| (145) | Alexander's Inc (REIT) | Goldman Sachs | 921 | (506) | Alphatec Holdings Inc | Bank of America | |
| (564) | Alexandria Real Estate | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (137) |
| | Equities Inc (REIT) | Merrill Lynch | 3.966 | (756) | Alphatec Holdings Inc | Goldman Sachs | (204) |
| (288) | Alexandria Real Estate | | | 95 | Alta Equipment Group Inc | Bank of America | |
| | Equities Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.992 | | | Merrill Lynch | (96) |
| (500) | Alexandria Real Estate | | | 266 | Alta Equipment Group Inc | Goldman Sachs | (269) |
| | Equities Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.185 | 23 | Altair Engineering Inc 'A' | Bank of America | |
| (2.105) | Alight Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 161 |
| | | Merrill Lynch | 232 | 90 | Altair Engineering Inc 'A' | Goldman Sachs | 632 |
| (13.682) | Alight Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.505 | 630 | Alteryx Inc 'A' | Bank of America | |
| (5.709) | Alight Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.884 | | | Merrill Lynch | 277 |
| 262 | Alignment Healthcare Inc | Bank of America | | 90 | Alteryx Inc 'A' | Goldman Sachs | (18) |
| | | Merrill Lynch | (275) | (663) | Altice USA Inc 'A' | Bank of America | |
| 629 | Alignment Healthcare Inc | Goldman Sachs | (660) | | | Merrill Lynch | (58) |
| (765) | Alkami Technology Inc | Bank of America | | 1.164 | Altria Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (927) | | | Merrill Lynch | (1.304) |
| (1.270) | Alkami Technology Inc | Goldman Sachs | (1.676) | 6.708 | Altria Group Inc | Goldman Sachs | (8.281) |
| 1.300 | Alkermes Plc | Goldman Sachs | (2.394) | 3.750 | Altria Group Inc | Morgan Stanley | (2.329) |
| 712 | Alkermes Plc | Morgan Stanley | (840) | (622) | Altus Power Inc | Bank of America | |
| (1.516) | Allbirds Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 242 |
| | | Merrill Lynch | 106 | (146) | Altus Power Inc | Goldman Sachs | 99 |
| (6.001) | Allbirds Inc 'A' | Goldman Sachs | 420 | 367 | Amalgamated Financial | Bank of America | |
| 70 | Allegiant Travel Co | Bank of America | | | Corp | Merrill Lynch | (29) |
| | | Merrill Lynch | (157) | 387 | Amalgamated Financial | | |
| 117 | Allegiant Travel Co | Goldman Sachs | (262) | | Corp | Goldman Sachs | (31) |
| (683) | Allegro MicroSystems Inc | Bank of America | | (417) | A-Mark Precious | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.427) | | Metals Inc | Merrill Lynch | 963 |
| (188) | Allegro MicroSystems Inc | Goldman Sachs | (393) | (343) | A-Mark Precious | | |
| (659) | Allegro MicroSystems Inc | Morgan Stanley | (455) | | Metals Inc | Goldman Sachs | 792 |
| 276 | ALLETE Inc | Bank of America | | 128 | Amazon.com Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (345) | | | Merrill Lynch | 1.354 |
| 563 | ALLETE Inc | Goldman Sachs | (704) | 1.560 | Amazon.com Inc | Goldman Sachs | 8.498 |
| (179) | Alliant Energy Corp | Goldman Sachs | 252 | 1.508 | Amazon.com Inc | Morgan Stanley | 10.211 |
| (3.011) | Alliant Energy Corp | Morgan Stanley | 4.296 | 659 | Ambac Financial Group Inc | Bank of America | |
| 39 | Allied Motion | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (540) |
| | Technologies Inc | Merrill Lynch | 32 | 319 | Ambarella Inc | Bank of America | |
| 54 | Allied Motion | | | | | Merrill Lynch | 287 |
| | Technologies Inc | Goldman Sachs | 37 | 576 | Ambarella Inc | Goldman Sachs | 869 |
| (52) | Allison Transmission | Bank of America | | 3.857 | AMC Entertainment | | |
| | Holdings Inc | Merrill Lynch | 23 | | Holdings Inc | Goldman Sachs | (289) |
| (77) | Allison Transmission | | | 512 | AMC Entertainment | | |
| | Holdings Inc | Goldman Sachs | 35 | | Holdings Inc | Morgan Stanley | (23) |
| (125) | Allison Transmission | | | (430) | AMC Networks Inc 'A' | Bank of America | |
| | Holdings Inc | Morgan Stanley | 121 | | | Merrill Lynch | 1.127 |
| 1.300 | Allogene Therapeutics Inc | Bank of America | | (267) | AMC Networks Inc 'A' | Goldman Sachs | 700 |
| | | Merrill Lynch | (1.989) | (1.655) | Ancor Plc | Bank of America | |
| 2.480 | Allogene Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (3.794) | | | Merrill Lynch | 1.175 |
| (76) | Allovir Inc | Bank of America | | (10.096) | Ancor Plc | Goldman Sachs | 7.168 |
| | | Merrill Lynch | 41 | (2.866) | Ancor Plc | Morgan Stanley | 1.777 |
| (327) | Allovir Inc | Goldman Sachs | 79 | (155) | Amerant Bancorp Inc | Bank of America | |
| 854 | Allstate Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (223) |
| | | Merrill Lynch | (6.807) | (514) | Amerant Bancorp Inc | Goldman Sachs | (740) |
| 340 | Allstate Corp | Goldman Sachs | (2.526) | (92) | Ameresco Inc 'A' | Bank of America | |
| 1.138 | Allstate Corp | Morgan Stanley | (8.792) | | | Merrill Lynch | 29 |
| 330 | Ally Financial Inc | Morgan Stanley | 36 | (188) | Ameresco Inc 'A' | Goldman Sachs | 60 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 773 | American Airlines Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 456 | 670 | AMETEK Inc | Goldman Sachs | (248) |
| 1.392 | American Airlines Group Inc | Goldman Sachs | 821 | 283 | AMETEK Inc | Morgan Stanley | (555) |
| 3.814 | American Airlines Group Inc | Morgan Stanley | 1.869 | 76 | Amgen Inc | Morgan Stanley | (415) |
| 3.136 | American Assets Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 627 | 793 | Amicus Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 32 |
| 2.780 | American Assets Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 556 | 1.430 | Amicus Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 57 |
| 1.619 | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (405) | (1.706) | Amkor Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.005) |
| 2.084 | American Axle & Manufacturing Holdings Inc | Goldman Sachs | (521) | (1.780) | Amkor Technology Inc | Goldman Sachs | (6.266) |
| (1.343) | American Eagle Outfitters Inc | Bank of America Merrill Lynch | 830 | (1.120) | Amkor Technology Inc | Morgan Stanley | (2.442) |
| (717) | American Electric Power Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.903 | 32 | AMN Healthcare Services Inc | Morgan Stanley | 30 |
| (653) | American Electric Power Co Inc | Goldman Sachs | 5.283 | 1.100 | Amneal | Bank of America Merrill Lynch | 297 |
| (1.809) | American Electric Power Co Inc | Morgan Stanley | 6.337 | 651 | Amneal Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 176 |
| (475) | American Equity Investment Life Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | (309) | 373 | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.108 |
| 15 | American Express Co | Bank of America Merrill Lynch | 127 | 265 | Amphastar Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 787 |
| 168 | American Express Co | Morgan Stanley | 494 | (2.237) | Amplitude Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.614 |
| 605 | American Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.257) | (411) | Amplitude Inc 'A' | Goldman Sachs | 386 |
| 361 | American Financial Group Inc | Goldman Sachs | (1.347) | (75) | Analog Devices Inc | Bank of America Merrill Lynch | (45) |
| 235 | American Financial Group Inc | Morgan Stanley | (665) | (52) | Analog Devices Inc | Goldman Sachs | (78) |
| 475 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (309) | 330 | AnaptyBio Inc | Bank of America Merrill Lynch | (198) |
| 627 | American Homes 4 Rent 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (408) | 591 | AnaptyBio Inc | Goldman Sachs | (355) |
| (287) | American International Group Inc | Goldman Sachs | (428) | (2.249) | Anavex Life Sciences Corp | Bank of America Merrill Lynch | 626 |
| (1.088) | American International Group Inc | Morgan Stanley | (76) | (606) | Anavex Life Sciences Corp | Goldman Sachs | 185 |
| 356 | American Software Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 160 | (101) | Andersons Inc | Bank of America Merrill Lynch | (198) |
| 591 | American Software Inc 'A' | Goldman Sachs | 266 | (206) | Andersons Inc | Goldman Sachs | (404) |
| (12) | American States Water Co | Bank of America Merrill Lynch | 25 | 795 | AngioDynamics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 24 |
| (453) | American States Water Co | Goldman Sachs | 942 | 212 | AngioDynamics Inc | Goldman Sachs | 11 |
| 339 | American Vanguard Corp | Bank of America Merrill Lynch | 58 | (51) | ANI Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (158) |
| 141 | American Vanguard Corp | Goldman Sachs | 24 | (14) | ANI Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (63) |
| 86 | American Woodmark Corp | Bank of America Merrill Lynch | 798 | 123 | Anika Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 143 |
| 436 | American Woodmark Corp | Goldman Sachs | 4.046 | 48 | Anika Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 56 |
| (96) | America's Car-Mart Inc | Bank of America Merrill Lynch | (537) | (2.802) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1) |
| (278) | America's Car-Mart Inc | Goldman Sachs | (1.554) | (1.455) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Goldman Sachs | (17) |
| (3.397) | Americold Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.800 | (6.750) | Annaly Capital Management Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.301 |
| 8 | Ameriprise Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (34) | 17 | ANSYS Inc | Goldman Sachs | 347 |
| 268 | AMERISAFE Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.110) | 20 | ANSYS Inc | Morgan Stanley | 39 |
| 108 | AMERISAFE Inc | Goldman Sachs | (447) | (118) | Anterix Inc | Bank of America Merrill Lynch | (235) |
| (572) | AmerisourceBergen Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.478 | (155) | Anterix Inc | Goldman Sachs | (229) |
| (98) | AmerisourceBergen Corp | Goldman Sachs | 773 | (1.110) | Antero Midstream Corp | Morgan Stanley | 722 |
| (670) | AmerisourceBergen Corp | Morgan Stanley | 4.556 | (189) | Antero Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | 369 |
| 43 | AMETEK Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16) | (1.477) | Antero Resources Corp | Morgan Stanley | 4.771 |
| | | | | 1.139 | Anywhere Real Estate Inc | Bank of America Merrill Lynch | (19) |
| | | | | 1.010 | Anywhere Real Estate Inc | Goldman Sachs | (115) |
| | | | | 97 | Aon Plc 'A' | Morgan Stanley | (1.755) |
| | | | | (319) | Apartment Income Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 274 |
| | | | | (1.375) | Apartment Income Corp (REIT) | Goldman Sachs | 1.183 |
| | | | | (58) | Apartment Income Corp (REIT) | Morgan Stanley | 38 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (367) | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 110 | 722 | Arcus Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 152 |
| (844) | Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) | Goldman Sachs | 253 | 669 | Arcus Biosciences Inc | Goldman Sachs | 140 |
| (261) | Apellis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | 37 | (3.655) | Ardelyx Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.249 |
| (337) | API Group Corp | Bank of America Merrill Lynch | (94) | (514) | Ardelyx Inc | Goldman Sachs | 280 |
| 1.018 | Apogee Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.680) | (965) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (743) |
| 1.212 | Apogee Enterprises Inc | Goldman Sachs | (2.000) | (1.514) | Ares Commercial Real Estate Corp (REIT) | Goldman Sachs | (1.166) |
| (1.963) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (923) | (297) | Argan Inc | Bank of America Merrill Lynch | 288 |
| (598) | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT) | Goldman Sachs | (281) | (394) | Argan Inc | Goldman Sachs | 382 |
| (372) | Apollo Global Management Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.507) | (50) | Arista Networks Inc | Morgan Stanley | (1.240) |
| (544) | Apollo Global Management Inc | Goldman Sachs | (2.203) | (69) | Arko Corp | Bank of America Merrill Lynch | (26) |
| (2.745) | Apollo Global Management Inc | Morgan Stanley | (3.376) | (689) | Arko Corp | Goldman Sachs | (255) |
| (44) | Apollo Medical Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 137 | 1.219 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (322) |
| (118) | Apollo Medical Holdings Inc | Goldman Sachs | 368 | 510 | Armada Hoffer Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (148) |
| 78 | Appfolio Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (118) | (11.430) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.714) |
| 32 | Appfolio Inc 'A' | Goldman Sachs | (48) | (2.187) | ARMOUR Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | (328) |
| (775) | Appian Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (4.851) | 33 | Armstrong World Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (83) |
| (976) | Appian Corp 'A' | Goldman Sachs | (5.837) | 411 | Armstrong World Industries Inc | Morgan Stanley | (974) |
| (1.408) | Apple Hospitality Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.197 | (678) | Array Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 531 |
| (351) | Apple Hospitality Inc (REIT) | Morgan Stanley | 190 | (1.066) | Array Technologies Inc | Goldman Sachs | 885 |
| 218 | Apple Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.492 | 83 | Arrow Electronics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 142 |
| 675 | Apple Inc | Goldman Sachs | 4.620 | 38 | Arrow Electronics Inc | Morgan Stanley | (1) |
| 495 | Apple Inc | Morgan Stanley | 2.334 | (73) | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 468 |
| (458) | Applied Industrial Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.658 | (43) | Artesian Resources Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 264 |
| (472) | Applied Industrial Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.581 | (77) | Artesian Resources Corp 'A' | Goldman Sachs | 472 |
| 249 | Applied Materials Inc | Morgan Stanley | 2.012 | 405 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (89) |
| (307) | AppLovin Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (565) | 339 | Artisan Partners Asset Management Inc 'A' | Goldman Sachs | (75) |
| (7.957) | AppLovin Corp 'A' | Morgan Stanley | 4.933 | (40) | Artivion Inc | Goldman Sachs | 15 |
| (45) | AptarGroup Inc | Bank of America Merrill Lynch | 333 | 742 | Arvinas Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.531) |
| (262) | AptarGroup Inc | Morgan Stanley | 1.294 | 782 | Arvinas Inc | Goldman Sachs | (1.619) |
| (1.130) | Aramark | Goldman Sachs | (918) | (553) | Asana Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.740) |
| (1.992) | Aramark | Morgan Stanley | 554 | (126) | Asana Inc 'A' | Goldman Sachs | (82) |
| 5.169 | Arbor Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 368 | (136) | Asana Inc 'A' | Morgan Stanley | (309) |
| (187) | ArcBest Corp | Bank of America Merrill Lynch | 247 | (26) | Asbury Automotive Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (283) |
| (216) | ArcBest Corp | Goldman Sachs | 285 | (93) | Asbury Automotive Group Inc | Goldman Sachs | (1.011) |
| (742) | Arcellx Inc | Bank of America Merrill Lynch | (742) | (40) | Asbury Automotive Group Inc | Morgan Stanley | (343) |
| (117) | Archer-Daniels-Midland Co | Bank of America Merrill Lynch | 625 | 211 | ASGN Inc | Bank of America Merrill Lynch | (101) |
| 1.605 | Archrock Inc | Bank of America Merrill Lynch | (835) | 601 | ASGN Inc | Goldman Sachs | 454 |
| 1.864 | Archrock Inc | Goldman Sachs | (969) | 127 | Ashland Inc | Bank of America Merrill Lynch | (472) |
| (387) | Arcosa Inc | Bank of America Merrill Lynch | 896 | 107 | Ashland Inc | Morgan Stanley | (179) |
| (262) | Arcosa Inc | Goldman Sachs | 559 | (476) | Aspen Aerogels Inc | Bank of America Merrill Lynch | 66 |
| (337) | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.267 | (54) | Aspen Technology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 184 |
| (397) | Arcturus Therapeutics Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.493 | (122) | Aspen Technology Inc | Goldman Sachs | 416 |
| | | | | (201) | Aspen Technology Inc | Morgan Stanley | 1.534 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 55 | AssetMark Financial Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 26 | 503 | Avid Technology Inc | Goldman Sachs | 2.077 |
| 191 | AssetMark Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 90 | 69 | Avidity Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17) |
| (33) | Associated Banc-Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3) | 505 | AvidXchange Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 189 |
| (320) | Associated Banc-Corp | Goldman Sachs | (29) | 957 | AvidXchange Holdings Inc | Goldman Sachs | 359 |
| (148) | Assurant Inc | Morgan Stanley | 1.144 | 303 | Avient Corp | Bank of America Merrill Lynch | (806) |
| 80 | Assured Guaranty Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (48) | 861 | Avient Corp | Goldman Sachs | (2.290) |
| 1.080 | Assured Guaranty Ltd | Goldman Sachs | (648) | 107 | Avis Budget Group Inc | Morgan Stanley | 43 |
| 211 | Astec Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (236) | (1.188) | Avista Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.376 |
| 294 | Astec Industries Inc | Goldman Sachs | (285) | (177) | Avnet Inc | Bank of America Merrill Lynch | (497) |
| 294 | ATI Inc | Bank of America Merrill Lynch | (606) | (692) | Avnet Inc | Goldman Sachs | (1.945) |
| (316) | Atkore Inc | Morgan Stanley | 1.608 | (110) | Avnet Inc | Morgan Stanley | (174) |
| (714) | Atlantic Union Bankshares Corp | Bank of America Merrill Lynch | (971) | (110) | Axalta Coating Systems Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 153 |
| (1.173) | Atlantic Union Bankshares Corp | Goldman Sachs | (1.595) | (930) | Axalta Coating Systems Ltd | Goldman Sachs | 1.293 |
| 755 | Atlantica Sustainable Infrastructure Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.661) | (1.124) | Axalta Coating Systems Ltd | Morgan Stanley | 1.495 |
| 2.292 | Atlantica Sustainable Infrastructure Plc | Morgan Stanley | (2.888) | 59 | Axcelis Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.850 |
| (21) | Atlanticus Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (99) | 159 | Axcelis Technologies Inc | Goldman Sachs | 4.985 |
| (7) | Atlanticus Holdings Corp | Goldman Sachs | (33) | 85 | Axcelis Technologies Inc | Morgan Stanley | 1.306 |
| (32) | Atlassian Corp Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (443) | 200 | Axis Capital Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (602) |
| (741) | Atmos Energy Corp | Goldman Sachs | 1.409 | 2 | Axis Capital Holdings Ltd | Goldman Sachs | (6) |
| (604) | Atmos Energy Corp | Morgan Stanley | 460 | 190 | Axogen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (82) |
| 529 | AtriCure Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.656) | 36 | Axogen Inc | Goldman Sachs | (15) |
| 615 | AtriCure Inc | Goldman Sachs | (1.925) | 18 | Axon Enterprise Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16) |
| 2 | Atrion Corp | Bank of America Merrill Lynch | (132) | 30 | Axon Enterprise Inc | Goldman Sachs | (181) |
| (3.006) | Aurinia Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.990 | 68 | Axon Enterprise Inc | Morgan Stanley | (470) |
| 245 | Autodesk Inc | Morgan Stanley | (1.485) | 217 | Axonics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.311) |
| (204) | Automatic Data Processing Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.441 | 259 | Axonics Inc | Goldman Sachs | (1.564) |
| (30) | Automatic Data Processing Inc | Goldman Sachs | 152 | 52 | Axos Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 133 |
| (2.109) | Automatic Data Processing Inc | Morgan Stanley | 12.276 | 340 | Axos Financial Inc | Goldman Sachs | 870 |
| 39 | AutoNation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (219) | (429) | Axsome Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.743 |
| 110 | AutoNation Inc | Goldman Sachs | (190) | 228 | Azenta Inc | Goldman Sachs | 264 |
| 101 | AutoNation Inc | Morgan Stanley | 92 | (563) | AZZ Inc | Bank of America Merrill Lynch | 282 |
| 19 | AutoZone Inc | Morgan Stanley | (5.354) | (300) | AZZ Inc | Goldman Sachs | 150 |
| (683) | Avangrid Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.015 | (2.901) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.654 |
| (78) | Avangrid Inc | Goldman Sachs | 230 | (3.501) | Babcock & Wilcox Enterprises Inc | Goldman Sachs | 1.996 |
| (499) | Avangrid Inc | Morgan Stanley | 873 | 197 | Badger Meter Inc | Bank of America Merrill Lynch | 378 |
| (813) | Avanos Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (634) | 123 | Badger Meter Inc | Goldman Sachs | 236 |
| (281) | Avanos Medical Inc | Goldman Sachs | (219) | (51) | Balchem Corp | Bank of America Merrill Lynch | 166 |
| 595 | Avantax Inc | Bank of America Merrill Lynch | 173 | (262) | Balchem Corp | Goldman Sachs | 852 |
| 389 | Avantax Inc | Goldman Sachs | 113 | (466) | Ball Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.502 |
| (319) | Avantor Inc | Bank of America Merrill Lynch | 64 | (695) | Ball Corp | Goldman Sachs | 3.732 |
| (991) | Avantor Inc | Goldman Sachs | 198 | (503) | Ball Corp | Morgan Stanley | 1.529 |
| (387) | Avantor Inc | Morgan Stanley | 255 | 84 | BancFirst Corp | Bank of America Merrill Lynch | 975 |
| (2.929) | AvePoint Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.318) | 35 | BancFirst Corp | Goldman Sachs | 406 |
| (2.670) | AvePoint Inc | Goldman Sachs | (3.004) | (25) | Bancorp Inc | Goldman Sachs | 24 |
| 238 | Avid Bioservices Inc | Bank of America Merrill Lynch | (607) | 501 | Bandwidth Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 205 |
| 440 | Avid Bioservices Inc | Goldman Sachs | (1.122) | 1.225 | Bandwidth Inc 'A' | Goldman Sachs | 502 |
| | | | | (39) | Bank First Corp | Goldman Sachs | (226) |
| | | | | 683 | Bank of America Corp | Goldman Sachs | (108) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|----------------------------------|---|---|----------------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.804 | Bank of America Corp | Morgan Stanley | (775) | (104) | BILL Holdings Inc | Morgan Stanley | (56) |
| 625 | Bank of Hawaii Corp | Bank of America | | (318) | BioCryst Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 237 |
| 489 | Bank of Hawaii Corp | Goldman Sachs | 3.231 | (862) | BioCryst Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 642 |
| 924 | Bank of New York Mellon Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.444 | (122) | Biohaven Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (245) |
| 780 | Bank of New York Mellon Corp | Goldman Sachs | 12 | (243) | Biohaven Ltd | Goldman Sachs | (488) |
| 180 | Bank of New York Mellon Corp | Morgan Stanley | (242) | (251) | BioLife Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (949) |
| (381) | Banner Corp | Bank of America Merrill Lynch | (74) | (127) | BioLife Solutions Inc | Goldman Sachs | (359) |
| (345) | Banner Corp | Goldman Sachs | (343) | 122 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (950) |
| 132 | Bar Harbor Bankshares | Bank of America Merrill Lynch | (311) | 112 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (872) |
| 72 | Bar Harbor Bankshares | Goldman Sachs | 177 | 118 | BioMarin Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley | (635) |
| (148) | Barnes Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 96 | (10.897) | Bionano Genomics Inc | Goldman Sachs | (385) |
| (1.136) | Barnes Group Inc | Goldman Sachs | 943 | 25 | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Goldman Sachs | (218) |
| (53) | Barrett Business Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (154) | 47 | Bio-Rad Laboratories Inc 'A' | Morgan Stanley | (663) |
| (62) | Barrett Business Services Inc | Goldman Sachs | (180) | (706) | Bioxcel Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.817 |
| (54) | Bath & Body Works Inc | Bank of America Merrill Lynch | 42 | (513) | Bioxcel Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 4.227 |
| (103) | Baxter International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 298 | 363 | BJ's Restaurants Inc | Bank of America Merrill Lynch | (352) |
| (45) | Baxter International Inc | Goldman Sachs | 123 | (107) | BJ's Restaurants Inc | Goldman Sachs | (317) |
| (247) | Baxter International Inc | Morgan Stanley | 609 | (460) | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 698 |
| 160 | Beacon Roofing Supply Inc | Bank of America Merrill Lynch | 562 | (431) | Black Hills Corp | Morgan Stanley | 2.770 |
| 123 | Beacon Roofing Supply Inc | Goldman Sachs | 432 | (333) | Black Hills Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.957 |
| 168 | Beacon Roofing Supply Inc | Morgan Stanley | 60 | (134) | Black Hills Corp | Goldman Sachs | 1.512 |
| 619 | Beam Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.414) | (137) | Blackbaud Inc | Morgan Stanley | 320 |
| 284 | Beam Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.108) | (150) | Blackbaud Inc | Bank of America Merrill Lynch | (47) |
| (1.430) | Beauty Health Co | Bank of America Merrill Lynch | 3.455 | (801) | Blink Charging Co | Goldman Sachs | (13) |
| (1.150) | Beauty Health Co | Goldman Sachs | 3.053 | 648 | Block Inc | Bank of America Merrill Lynch | 417 |
| (209) | Becton Dickinson & Co | Morgan Stanley | 2.552 | 530 | Block Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.263 |
| 304 | Belden Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.496 | 3.689 | Block Inc | Morgan Stanley | 1.653 |
| 439 | Belden Inc | Goldman Sachs | 2.160 | (1.199) | Bloom Energy Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (887) |
| 581 | Benchmark Electronics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 906 | (742) | Bloom Energy Corp 'A' | Goldman Sachs | (549) |
| 1.111 | Benchmark Electronics Inc | Goldman Sachs | 1.691 | (1.253) | Bloom Energy Corp 'A' | Morgan Stanley | 1.140 |
| (128) | Benson Hill Inc | Goldman Sachs | 1 | (31) | Bloomin' Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 35 |
| (1.285) | Bentley Systems Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (3.829) | (804) | Bloomin' Brands Inc | Goldman Sachs | (138) |
| (1.129) | Bentley Systems Inc 'B' | Goldman Sachs | (3.364) | (266) | Blue Bird Corp | Bank of America Merrill Lynch | (508) |
| (91) | Berkshire Hathaway Inc 'B' | Goldman Sachs | (90) | (124) | Blue Bird Corp | Goldman Sachs | (285) |
| (103) | Berkshire Hills Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (157) | (1.771) | Blue Owl Capital Inc | Bank of America Merrill Lynch | 204 |
| (64) | Berkshire Hills Bancorp Inc | Goldman Sachs | (97) | (1.810) | Blue Owl Capital Inc | Goldman Sachs | 208 |
| 2.494 | Berry Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.471) | (4.133) | Blue Owl Capital Inc | Morgan Stanley | 434 |
| 1.452 | Berry Corp | Goldman Sachs | (857) | 567 | Bluebird Bio Inc | Bank of America Merrill Lynch | (437) |
| (93) | Berry Global Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 171 | 410 | Bluebird Bio Inc | Goldman Sachs | (316) |
| (121) | Berry Global Group Inc | Morgan Stanley | 240 | (44) | BlueLinx Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (68) |
| 716 | Best Buy Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 43 | (58) | BlueLinx Holdings Inc | Goldman Sachs | 11 |
| 339 | Best Buy Co Inc | Morgan Stanley | 827 | 190 | Blueprint Medicines Corp | Bank of America Merrill Lynch | 94 |
| (228) | BGC Partners Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 40 | 402 | Blueprint Medicines Corp | Goldman Sachs | 422 |
| (217) | BGC Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 38 | 205 | Boeing Co | Goldman Sachs | 396 |
| (1.017) | Big Lots Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.959 | 51 | Boise Cascade Co | Bank of America Merrill Lynch | (78) |
| (2.789) | BigCommerce Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 230 | 204 | Boise Cascade Co | Goldman Sachs | (312) |
| (75) | BILL Holdings Inc | Goldman Sachs | (188) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 155 | BOK Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 615 | (353) | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 258 |
| 413 | BOK Financial Corp | Goldman Sachs | 1.640 | (1.620) | Broadstone Net Lease Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.377 |
| 20 | Booking Holdings Inc | Morgan Stanley | (4.423) | 676 | Brookdale Senior Living Inc | Bank of America Merrill Lynch | (196) |
| (178) | Boot Barn Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 703 | 7.077 | Brookdale Senior Living Inc | Goldman Sachs | (2.052) |
| (221) | Boot Barn Holdings Inc | Goldman Sachs | 855 | (625) | Brookfield Realty Capital Corp | Bank of America Merrill Lynch | (19) |
| 36 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 301 | (407) | Brookline Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (206) |
| 22 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | Morgan Stanley | 43 | (756) | Brookline Bancorp Inc | Goldman Sachs | (382) |
| 25 | Boston Beer Co Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 585 | (426) | Brown & Brown Inc | Morgan Stanley | 1.470 |
| 10 | Boston Beer Co Inc 'A' | Goldman Sachs | 234 | (131) | Brown-Forman Corp 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 89 |
| 99 | Boston Beer Co Inc 'A' | Morgan Stanley | 586 | (737) | Brown-Forman Corp 'B' | Goldman Sachs | 1.865 |
| (508) | Boston Omaha Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 168 | (39) | Brown-Forman Corp 'B' | Morgan Stanley | 2 |
| (466) | Boston Omaha Corp 'A' | Goldman Sachs | 154 | (682) | BRP Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.228 |
| (1.525) | Boston Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 254 | (879) | BRP Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.582 |
| (2.158) | Boston Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 530 | 118 | Brucker Corp | Goldman Sachs | (444) |
| (2.055) | Boston Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.493 | 876 | Brucker Corp | Morgan Stanley | (5.685) |
| 61 | Boston Scientific Corp | Bank of America Merrill Lynch | (171) | (623) | Brunswick Corp | Morgan Stanley | 554 |
| 609 | Boston Scientific Corp | Morgan Stanley | (1.870) | 493 | Buckle Inc | Goldman Sachs | (1.208) |
| (246) | Bowlero Corp | Bank of America Merrill Lynch | 501 | 80 | Builders FirstSource Inc | Goldman Sachs | (104) |
| 1.938 | Box Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.236 | (2.666) | Bumble Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.532 |
| 2.336 | Box Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.313 | (258) | Bunge Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (214) |
| 275 | Boyd Gaming Corp | Morgan Stanley | (683) | (82) | Bunge Ltd | Goldman Sachs | (68) |
| (82) | Brady Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 263 | (252) | Bunge Ltd | Morgan Stanley | (592) |
| (460) | Brady Corp 'A' | Goldman Sachs | 1.477 | 33 | Business First Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 13 |
| (1.693) | Braze Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (3.965) | 25 | Business First Bancshares Inc | Goldman Sachs | 10 |
| (39) | Braze Inc 'A' | Goldman Sachs | (95) | (28) | Butterfly Network Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11) |
| 347 | Bread Financial Holdings Inc | Goldman Sachs | 427 | (2.555) | Butterfly Network Inc | Goldman Sachs | (1.022) |
| (201) | Bridgebio Pharma Inc | Goldman Sachs | (5) | 718 | Byline Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 294 |
| 206 | Brighthouse Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (41) | 657 | Byline Bancorp Inc | Goldman Sachs | 269 |
| 705 | Brighthouse Financial Inc | Goldman Sachs | (115) | 2 | CACI International Inc 'A' | Goldman Sachs | (11) |
| 1.230 | Brighthouse Financial Inc | Morgan Stanley | (1.316) | 197 | CACI International Inc 'A' | Morgan Stanley | (333) |
| (263) | BrightSphere Investment Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (18) | (172) | Cactus Inc 'A' | Goldman Sachs | 635 |
| (848) | BrightSphere Investment Group Inc | Goldman Sachs | (153) | (356) | Cactus Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.282 |
| (127) | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (66) | (176) | Cadence Bank | Bank of America Merrill Lynch | (74) |
| (100) | BrightSpire Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (52) | (172) | Cadence Bank | Goldman Sachs | (72) |
| (338) | BrightView Holdings Inc | Goldman Sachs | (27) | (368) | Cadence Bank | Morgan Stanley | 305 |
| (732) | Brinker International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.215 | (305) | Cadre Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 268 |
| (652) | Brinker International Inc | Goldman Sachs | 1.094 | (82) | Cadre Holdings Inc | Goldman Sachs | 72 |
| 745 | Brink's Co | Bank of America Merrill Lynch | 329 | (723) | Caesars Entertainment Inc | Morgan Stanley | 2.755 |
| 349 | Brink's Co | Goldman Sachs | 152 | (432) | Calavo Growers Inc | Bank of America Merrill Lynch | (881) |
| 953 | Bristol-Myers Squibb Co | Bank of America Merrill Lynch | (4.222) | (577) | Calavo Growers Inc | Goldman Sachs | (1.177) |
| 817 | Bristol-Myers Squibb Co | Goldman Sachs | (3.619) | 366 | Caleres Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.031) |
| 1.529 | Bristol-Myers Squibb Co | Morgan Stanley | (3.165) | 332 | Caleres Inc | Goldman Sachs | (1.843) |
| 67 | Bristow Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 116 | 943 | California Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.254) |
| 140 | Bristow Group Inc | Goldman Sachs | 242 | 883 | California Resources Corp | Goldman Sachs | (2.101) |
| (83) | Broadcom Inc | Bank of America Merrill Lynch | (8.933) | (183) | California Water Service Group | Bank of America Merrill Lynch | 38 |
| (55) | Broadcom Inc | Goldman Sachs | (9.097) | (682) | California Water Service Group | Goldman Sachs | 143 |
| (114) | Broadcom Inc | Morgan Stanley | (14.459) | (60) | Calix Inc | Bank of America Merrill Lynch | (61) |
| (250) | Broadridge Financial Solutions Inc | Goldman Sachs | 2.128 | (424) | Calix Inc | Goldman Sachs | (432) |
| | | | | (598) | Calix Inc | Morgan Stanley | 443 |
| | | | | 46 | Callon Petroleum Co | Bank of America Merrill Lynch | (63) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|--|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 677 | Callon Petroleum Co | Goldman Sachs | (1.002) | (293) | Carriage Services Inc | Bank of America | 604 |
| (223) | Cal-Maine Foods Inc | Bank of America Merrill Lynch | (80) | (324) | Carriage Services Inc | Goldman Sachs | 667 |
| (42) | Cambium Networks Corp ^{tr} | Bank of America Merrill Lynch | — | (461) | Cars.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | 590 |
| 7 | Cambridge Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 22 | (596) | Cars.com Inc | Goldman Sachs | 763 |
| 14 | Cambridge Bancorp | Goldman Sachs | 43 | (494) | Carter's Inc | Bank of America Merrill Lynch | 849 |
| 259 | Camden Property Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.101) | (130) | Carter's Inc | Goldman Sachs | 238 |
| 76 | Camden Property Trust (REIT) | Goldman Sachs | (323) | (232) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 675 |
| 149 | Camden Property Trust (REIT) | Goldman Sachs | (323) | (1.257) | Casella Waste Systems Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.658 |
| (2.185) | Camping World Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch | (250) | (598) | Cass Information Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.017) |
| (1.521) | Camping World Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch | (2.666) | (295) | Cass Information Systems Inc | Goldman Sachs | (502) |
| 835 | Canada Goose Holdings Inc | Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch | (1.856) | (371) | Cassava Sciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.313 |
| 857 | Canada Goose Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.125) | (32) | Castle Biosciences Inc | Goldman Sachs | (12) |
| 1.711 | Canada Goose Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.234) | (152) | Catalent Inc | Bank of America Merrill Lynch | (494) |
| (573) | Canadian Solar Inc | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch | (2.139) | (803) | Catalent Inc | Goldman Sachs | (2.610) |
| (300) | Canadian Solar Inc | Goldman Sachs | (4.229) | (288) | Catalent Inc | Morgan Stanley | 308 |
| (542) | Canadian Solar Inc | Goldman Sachs | (2.214) | (60) | Catalyst Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 96 |
| 464 | Cannae Holdings Inc | Morgan Stanley Goldman Sachs | (228) | (466) | Catalyst Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 703 |
| (5.213) | Cano Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | (156) | (397) | Cathay General Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (480) |
| (3.078) | Cano Health Inc | Goldman Sachs | (92) | (738) | Cathay General Bancorp | Goldman Sachs | (893) |
| 473 | Capital City Bank Group Inc | Goldman Sachs | 378 | (68) | Cavco Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.715 |
| (1.046) | Capitol Federal Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (481) | (47) | Cavco Industries Inc | Goldman Sachs | 1.877 |
| (1.598) | Capitol Federal Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (735) | (312) | CBIZ Inc | Bank of America Merrill Lynch | (172) |
| 147 | Capri Holdings Ltd | Goldman Sachs | (569) | (915) | CBIZ Inc | Goldman Sachs | (503) |
| 762 | Capri Holdings Ltd | Goldman Sachs | (2.355) | (43) | CBL & Associates Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 3 |
| 214 | CareDx Inc | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch | (103) | (224) | CBRE Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 8 |
| 1.035 | CareDx Inc | Goldman Sachs | (497) | (265) | CBRE Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 145 |
| (2.066) | CareMax Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2) | (1.694) | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.202) |
| (4.196) | CareMax Inc | Bank of America Merrill Lynch | 360 | (2.939) | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc | Goldman Sachs | (4.179) |
| (607) | CareTrust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 704 | (99) | CDW Corp | Morgan Stanley | 307 |
| (1.063) | CareTrust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.233 | (354) | Celanese Corp | Bank of America Merrill Lynch | 142 |
| 789 | Cargurus Inc | Goldman Sachs | (245) | (714) | Celanese Corp | Goldman Sachs | 286 |
| (656) | Caribou Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 184 | (370) | Celanese Corp | Morgan Stanley | 1.362 |
| (1.236) | Caribou Biosciences Inc | Goldman Sachs | 346 | (960) | Celldex Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 2.630 |
| 83 | Carlisle Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8 | 61 | Centene Corp | Goldman Sachs | (24) |
| 94 | Carlisle Cos Inc | Goldman Sachs | 9 | (1.516) | CenterPoint Energy Inc | Morgan Stanley | 803 |
| 172 | Carlisle Cos Inc | Morgan Stanley | 28 | (294) | Centerspace (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (118) |
| (236) | CarMax Inc | Bank of America Merrill Lynch | (120) | (291) | Centerspace (REIT) | Goldman Sachs | (116) |
| (32) | CarMax Inc | Goldman Sachs | (16) | (120) | Central Garden & Pet Co | Bank of America Merrill Lynch | 18 |
| (42) | CarMax Inc | Morgan Stanley | — | (77) | Central Garden & Pet Co | Goldman Sachs | 12 |
| 4.422 | Carnival Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.466 | 261 | Central Garden & Pet Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (49) |
| 2.966 | Carnival Corp | Goldman Sachs | 2.853 | 321 | Central Garden & Pet Co 'A' | Goldman Sachs | (161) |
| 3.795 | Carnival Corp | Morgan Stanley | 380 | (254) | Centrus Energy Corp 'A' | Goldman Sachs | 564 |
| (831) | CarParts.com Inc | Bank of America Merrill Lynch | 137 | 1.479 | Century Aluminum Co | Bank of America Merrill Lynch | 164 |
| (468) | CarParts.com Inc | Goldman Sachs | 77 | 1.420 | Century Aluminum Co | Goldman Sachs | 213 |
| 216 | Carpenter Technology Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.140) | 67 | Century Communities Inc | Bank of America Merrill Lynch | (223) |
| 122 | Carpenter Technology Corp | Goldman Sachs | (644) | 141 | Century Communities Inc | Goldman Sachs | (470) |
| | | | | 466 | Cerence Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.293 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|---------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 224 | Cerence Inc | Goldman Sachs | 1.102 | 3.388 | Chimera Investment Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (440) |
| (976) | Cerevel Therapeutics Holdings Inc | Goldman Sachs | (577) | 926 | Chimera Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (120) |
| (499) | Ceridian HCM Holding Inc | Bank of America Merrill Lynch | (913) | (3) | Chipotle Mexican Grill Inc | Bank of America Merrill Lynch | 12 |
| (99) | Ceridian HCM Holding Inc | Goldman Sachs | (181) | (2) | Chipotle Mexican Grill Inc | Morgan Stanley | 26 |
| (383) | Ceridian HCM Holding Inc | Morgan Stanley | 716 | 20 | Choice Hotels International Inc | Morgan Stanley | 30 |
| (998) | Certara Inc | Bank of America Merrill Lynch | (848) | (273) | Churchill Downs Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17.580) |
| (1.102) | Certara Inc | Goldman Sachs | (937) | (97) | Churchill Downs Inc | Goldman Sachs | (2.293) |
| 190 | Cerus Corp | Bank of America Merrill Lynch | 33 | (402) | Churchill Downs Inc | Morgan Stanley | 2.709 |
| 139 | Cerus Corp | Goldman Sachs | 24 | (106) | Chuy's Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 69 |
| 185 | CEVA Inc | Bank of America Merrill Lynch | 459 | (154) | Chuy's Holdings Inc | Goldman Sachs | 100 |
| 603 | CEVA Inc | Goldman Sachs | 1.180 | 101 | Cigna Group | Bank of America Merrill Lynch | (1.453) |
| (874) | CF Industries Holdings Inc | Morgan Stanley | 4.379 | 140 | Cigna Group | Goldman Sachs | (2.015) |
| (105) | CH Robinson Worldwide Inc | Morgan Stanley | 564 | 114 | Cigna Group | Morgan Stanley | (1.358) |
| (71) | ChampionX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 67 | 97 | Cimpress Plc | Bank of America Merrill Lynch | 18 |
| (971) | ChampionX Corp | Goldman Sachs | 913 | 375 | Cimpress Plc | Goldman Sachs | 71 |
| 160 | Charles River Laboratories International Inc | Morgan Stanley | (1.206) | 20 | Cincinnati Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (123) |
| (198) | Charles Schwab Corp | Bank of America Merrill Lynch | (69) | 145 | Cincinnati Financial Corp | Goldman Sachs | (893) |
| (544) | Charles Schwab Corp | Goldman Sachs | (786) | 122 | Cincinnati Financial Corp | Morgan Stanley | (803) |
| 113 | Chart Industries Inc | Goldman Sachs | (181) | 41 | Cinemark Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (43) |
| 366 | Chart Industries Inc | Morgan Stanley | (2.972) | 1.956 | Cinemark Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.034) |
| 49 | Charter Communications Inc 'A' | Morgan Stanley | (541) | 59 | Cintas Corp | Bank of America Merrill Lynch | 26 |
| (62) | Chase Corp | Bank of America Merrill Lynch | (240) | 126 | Cintas Corp | Goldman Sachs | 55 |
| (73) | Chase Corp | Goldman Sachs | (343) | 146 | Cintas Corp | Morgan Stanley | (310) |
| 1.122 | Chatham Lodging Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (606) | 460 | CIRCOR International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (534) |
| 1.632 | Chatham Lodging Trust (REIT) | Goldman Sachs | (881) | 650 | CIRCOR International Inc | Goldman Sachs | (754) |
| 106 | Check Point Software Technologies Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 454 | 388 | Cirrus Logic Inc | Bank of America Merrill Lynch | (947) |
| 258 | Check Point Software Technologies Ltd | Goldman Sachs | 1.022 | 854 | Cirrus Logic Inc | Goldman Sachs | (2.084) |
| 256 | Check Point Software Technologies Ltd | Goldman Sachs | 1.022 | (86) | Cisco Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (255) |
| (319) | Cheesecake Factory Inc | Morgan Stanley | 361 | (313) | Cisco Systems Inc | Goldman Sachs | (737) |
| (178) | Chefs' Warehouse Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10 | (220) | Cisco Systems Inc | Morgan Stanley | (233) |
| 1.280 | Chegg Inc | Goldman Sachs | 388 | 70 | Citigroup Inc | Bank of America Merrill Lynch | (87) |
| 4.602 | Chegg Inc | Bank of America Merrill Lynch | (113) | 530 | Citigroup Inc | Goldman Sachs | (599) |
| 147 | Chemed Corp | Goldman Sachs | (1.885) | 461 | Citigroup Inc | Morgan Stanley | (236) |
| 41 | Chemed Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.406) | 1.017 | Citizens Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 648 |
| 106 | Chemed Corp | Goldman Sachs | (632) | (42) | City Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | (119) |
| (649) | Chemours Co | Morgan Stanley | (1.146) | (166) | City Holding Co | Goldman Sachs | (470) |
| (309) | Chemours Co | Goldman Sachs | 1.201 | (619) | Civitas Resources Inc | Bank of America Merrill Lynch | (328) |
| 311 | Chemours Co | Morgan Stanley | 621 | (1.206) | Civitas Resources Inc | Goldman Sachs | (639) |
| (61) | Cheniere Energy Inc | Morgan Stanley | (2.193) | (756) | Civitas Resources Inc | Morgan Stanley | 2.699 |
| (1.230) | Chesapeake Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 378 | (6.099) | Clarivate Plc | Goldman Sachs | 3.263 |
| (95) | Chesapeake Utilities Corp | Morgan Stanley | 7.380 | (4.738) | Clarivate Plc | Morgan Stanley | (687) |
| (103) | Chesapeake Utilities Corp | Bank of America Merrill Lynch | (20) | (3.164) | Claros Mortgage Trust Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.740 |
| 229 | Chevron Corp | Goldman Sachs | (23) | (280) | Clarus Corp | Goldman Sachs | 162 |
| 357 | Chevron Corp | Goldman Sachs | (1.193) | 1.007 | Clean Energy Fuels Corp | Bank of America Merrill Lynch | (665) |
| 241 | Chewy Inc 'A' | Morgan Stanley | (161) | 2.448 | Clean Energy Fuels Corp | Goldman Sachs | (1.616) |
| 955 | Chewy Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.089) | (199) | Clean Harbors Inc | Bank of America Merrill Lynch | (802) |
| 1.268 | Chico's FAS Inc | Morgan Stanley | (2.263) | (66) | Clean Harbors Inc | Goldman Sachs | (266) |
| 3.592 | Chico's FAS Inc | Bank of America Merrill Lynch | (127) | (89) | Clean Harbors Inc | Morgan Stanley | 183 |
| (350) | Children's Place Inc | Goldman Sachs | (359) | (623) | Clear Secure Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 56 |
| (705) | Children's Place Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.759 | (391) | Clear Secure Inc 'A' | Morgan Stanley | 235 |
| | | Goldman Sachs | 7.572 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|---------------------------------------|--------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (465) | Clearfield Inc | Bank of America | | (299) | Cohu Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (476) | | | Merrill Lynch | (894) |
| (571) | Clearfield Inc | Goldman Sachs | (505) | (383) | Cohu Inc | Goldman Sachs | (1.162) |
| (70) | Clearwater Analytics Holdings Inc 'A' | Bank of America | | (205) | Colgate-Palmolive Co | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (55) | | | Merrill Lynch | 1.261 |
| (179) | Clearwater Analytics Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (140) | (523) | Colgate-Palmolive Co | Goldman Sachs | 814 |
| 331 | Clearwater Paper Corp | Bank of America | | (52) | Colgate-Palmolive Co | Morgan Stanley | 132 |
| | | Merrill Lynch | (238) | 174 | Collegium | Bank of America | |
| 430 | Clearwater Paper Corp | Goldman Sachs | (310) | | Pharmaceutical Inc | Merrill Lynch | (299) |
| 690 | Clearway Energy Inc 'A' | Bank of America | | 175 | Collegium | Pharmaceutical Inc | (301) |
| | | Merrill Lynch | (1.973) | 467 | Columbia Banking System Inc | Bank of America | |
| 565 | Clearway Energy Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.616) | | | Merrill Lynch | (47) |
| (175) | Clearway Energy Inc 'C' | Bank of America | | 194 | Columbia Banking System Inc | Goldman Sachs | (19) |
| | | Merrill Lynch | 138 | (524) | Columbia Financial Inc | Bank of America | |
| (47) | Clearway Energy Inc 'C' | Goldman Sachs | 75 | | | Merrill Lynch | (220) |
| 1.099 | Cleveland-Cliffs Inc | Bank of America | | (648) | Columbia Financial Inc | Goldman Sachs | (272) |
| | | Merrill Lynch | (1.231) | 289 | Columbia Sportswear Co | Bank of America | |
| 535 | Cleveland-Cliffs Inc | Goldman Sachs | (599) | | | Merrill Lynch | (1.133) |
| 207 | Cleveland-Cliffs Inc | Morgan Stanley | (215) | 424 | Columbia Sportswear Co | Goldman Sachs | (1.662) |
| (45) | Clorox Co | Bank of America | | 464 | Columbia Sportswear Co | Morgan Stanley | (1.355) |
| | | Merrill Lynch | 445 | (281) | Columbus McKinnon Corp | Bank of America | |
| (584) | Clorox Co | Morgan Stanley | 3.300 | | | Merrill Lynch | (329) |
| (348) | Cloudflare Inc 'A' | Morgan Stanley | (3.727) | (286) | Columbus McKinnon Corp | Goldman Sachs | (485) |
| 2 | Clovis Oncology Inc [†] | Goldman Sachs | — | (552) | Comcast Corp 'A' | Goldman Sachs | 541 |
| (54) | CME Group Inc | Bank of America | | (366) | Comcast Corp 'A' | Morgan Stanley | 384 |
| | | Merrill Lynch | 251 | 52 | Comerica Inc | Bank of America | |
| (165) | CME Group Inc | Goldman Sachs | 1.081 | | | Merrill Lynch | 116 |
| (125) | CME Group Inc | Morgan Stanley | 514 | 151 | Comerica Inc | Goldman Sachs | 338 |
| 1.899 | CNO Financial Group Inc | Bank of America | | 622 | Comerica Inc | Morgan Stanley | (1.947) |
| | | Merrill Lynch | 893 | (58) | Comfort Systems USA Inc | Bank of America | |
| 506 | CNO Financial Group Inc | Goldman Sachs | 238 | | | Merrill Lynch | 76 |
| 622 | CNX Resources Corp | Bank of America | | (31) | Comfort Systems USA Inc | Goldman Sachs | 41 |
| | | Merrill Lynch | (302) | (79) | Comfort Systems USA Inc | Morgan Stanley | 67 |
| 1.154 | CNX Resources Corp | Goldman Sachs | (405) | (229) | Commerce Bancshares Inc | Bank of America | |
| (12) | Coastal Financial Corp | Goldman Sachs | (10) | | | Merrill Lynch | 382 |
| 3.582 | Coca-Cola Co | Bank of America | | (190) | Commerce Bancshares Inc | Goldman Sachs | 317 |
| | | Merrill Lynch | (16.070) | (492) | Commerce Bancshares Inc | Morgan Stanley | 507 |
| 533 | Coca-Cola Co | Goldman Sachs | (2.404) | 45 | Commercial Metals Co | Bank of America | |
| 1.424 | Coca-Cola Co | Morgan Stanley | (2.883) | | | Merrill Lynch | (64) |
| (104) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Bank of America | | 163 | Commercial Metals Co | Goldman Sachs | (233) |
| | | Merrill Lynch | 448 | 567 | Commercial Metals Co | Morgan Stanley | (1.372) |
| (674) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Goldman Sachs | 2.905 | 519 | CommScope Holding Co Inc | Bank of America | |
| (1.258) | Coca-Cola Europacific Partners Plc | Morgan Stanley | 3.673 | | | Merrill Lynch | (145) |
| 2.109 | Codexis Inc | Bank of America | | 824 | CommScope Holding Co Inc | Goldman Sachs | (231) |
| | | Merrill Lynch | (970) | (870) | Community Bank System Inc | Bank of America | |
| 2.235 | Codexis Inc | Goldman Sachs | (1.028) | | | Merrill Lynch | (2.854) |
| 2.859 | Coeur Mining Inc | Bank of America | | (291) | Community Bank System Inc | Goldman Sachs | (954) |
| | | Merrill Lynch | (1.029) | 1.108 | Community Health Systems Inc | Bank of America | |
| 1.779 | Coeur Mining Inc | Goldman Sachs | (640) | | | Merrill Lynch | (421) |
| (90) | Cogent Biosciences Inc | Bank of America | | 1.995 | Community Health Systems Inc | Goldman Sachs | (758) |
| | | Merrill Lynch | 20 | (585) | Community Healthcare Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| (957) | Cogent Biosciences Inc | Goldman Sachs | 211 | | | Merrill Lynch | 1.580 |
| (1.069) | Cogent Communications Holdings Inc | Bank of America | | (793) | Community Healthcare Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.141 |
| | | Merrill Lynch | 68 | (228) | Community Trust Bancorp Inc | Bank of America | |
| (413) | Cogent Communications Holdings Inc | Goldman Sachs | 50 | | | Merrill Lynch | (115) |
| (796) | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Goldman Sachs | 43 | (248) | Community Trust Bancorp Inc | Goldman Sachs | (125) |
| (961) | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | Morgan Stanley | (110) | 1.283 | CommVault Systems Inc | Bank of America | |
| (179) | Cohen & Steers Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 8.214 |
| | | Merrill Lynch | 113 | 843 | CommVault Systems Inc | Goldman Sachs | 5.446 |
| (296) | Cohen & Steers Inc | Goldman Sachs | 186 | 567 | Compass Minerals International Inc | Bank of America | |
| (936) | Coherent Corp | Goldman Sachs | (8.621) | | | Merrill Lynch | (873) |
| (1.281) | Coherent Corp | Morgan Stanley | (7.648) | 498 | Compass Minerals International Inc | Goldman Sachs | (767) |
| 173 | Coherus Biosciences Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (149) | | | | |
| 2.451 | Coherus Biosciences Inc | Goldman Sachs | (2.108) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 156 | Computer Programs and Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11) | (304) | Couchbase Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.192) |
| 272 | Computer Programs and Systems Inc | Goldman Sachs | 104 | (922) | Couchbase Inc | Goldman Sachs | (3.614) |
| (143) | Concentrix Corp | Bank of America Merrill Lynch | 573 | (1.459) | Coursera Inc | Bank of America Merrill Lynch | (584) |
| (217) | Concentrix Corp | Goldman Sachs | 870 | (1.983) | Coursera Inc | Goldman Sachs | (691) |
| (2.315) | Conduent Inc | Bank of America Merrill Lynch | (289) | (540) | Cousins Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (264) |
| (2.949) | Conduent Inc | Goldman Sachs | (302) | (2.156) | Cousins Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (220) |
| (1.575) | Confluent Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (11.482) | (1.966) | Cousins Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 628 |
| (1.746) | Confluent Inc 'A' | Goldman Sachs | (12.728) | 121 | Covenant Logistics Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (39) |
| (671) | Confluent Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.912) | 68 | Covenant Logistics Group Inc | Goldman Sachs | (22) |
| (289) | CONMED Corp | Bank of America Merrill Lynch | 983 | (11) | CRA International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 50 |
| (124) | CONMED Corp | Goldman Sachs | 348 | 294 | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.418) |
| 691 | ConnectOne Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (149) | 45 | Cracker Barrel Old Country Store Inc | Goldman Sachs | (567) |
| 971 | ConnectOne Bancorp Inc | Goldman Sachs | (183) | (110) | Crane Co | Bank of America Merrill Lynch | 334 |
| 127 | ConocoPhillips | Bank of America Merrill Lynch | 5 | (95) | Crane Co | Goldman Sachs | 289 |
| 37 | ConocoPhillips | Goldman Sachs | (135) | (426) | Crane Co | Morgan Stanley | 358 |
| 425 | ConocoPhillips | Morgan Stanley | (1.445) | 605 | Crane NXT Co | Bank of America Merrill Lynch | 542 |
| (387) | Consensus Cloud Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (316) | 430 | Crane NXT Co | Goldman Sachs | 32 |
| (629) | Consensus Cloud Solutions Inc | Goldman Sachs | (479) | 180 | Credit Acceptance Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.945 |
| (921) | Consolidated Edison Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.663 | 36 | Credit Acceptance Corp | Goldman Sachs | 589 |
| (547) | Consolidated Edison Inc | Goldman Sachs | 812 | 35 | Credit Acceptance Corp | Morgan Stanley | 363 |
| (837) | Consolidated Edison Inc | Morgan Stanley | 974 | (2.256) | Credo Technology Group Holding Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (11.460) |
| (44) | Constellation Energy Corp | Bank of America Merrill Lynch | 8 | (3.383) | Credo Technology Group Holding Ltd | Goldman Sachs | (17.186) |
| (341) | Constellation Energy Corp | Goldman Sachs | (250) | (858) | Crescent Energy Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 443 |
| (710) | Constellation Energy Corp | Morgan Stanley | 14 | (264) | Crinetics Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 116 |
| (229) | Construction Partners Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (64) | (222) | Crinetics Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 98 |
| (165) | Construction Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | (25) | 115 | Crocs Inc | Morgan Stanley | 536 |
| (55) | Cooper Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.197 | (690) | Cross Country Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (538) |
| (43) | Cooper Cos Inc | Goldman Sachs | 936 | (652) | Cross Country Healthcare Inc | Goldman Sachs | (509) |
| (217) | Cooper Cos Inc | Morgan Stanley | 4.896 | 72 | CrossFirst Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 14 |
| 1.378 | Corcept Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.012) | 528 | CrossFirst Bankshares Inc | Goldman Sachs | 100 |
| 1.993 | Corcept Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (1.531) | (149) | Crown Castle Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 121 |
| 8 | Core & Main Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2) | (133) | Crown Castle Inc (REIT) | Goldman Sachs | 67 |
| 1.861 | Core & Main Inc 'A' | Goldman Sachs | (391) | (32) | Crown Castle Inc (REIT) | Morgan Stanley | 104 |
| (4.385) | Corebridge Financial Inc | Goldman Sachs | (1.228) | (230) | CryoPort Inc | Bank of America Merrill Lynch | 462 |
| (8.133) | Corebridge Financial Inc | Morgan Stanley | 2.603 | (316) | CryoPort Inc | Goldman Sachs | 491 |
| 697 | CoreCivic Inc | Bank of America Merrill Lynch | (376) | (552) | CS Disco Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.242) |
| 455 | CoreCivic Inc | Goldman Sachs | (246) | (1.016) | CS Disco Inc | Goldman Sachs | (2.286) |
| (474) | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 343 | 812 | CSG Systems International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.333) |
| (1.268) | Corporate Office Properties Trust (REIT) | Goldman Sachs | 871 | 757 | CSG Systems International Inc | Goldman Sachs | (1.323) |
| (621) | Corteva Inc | Morgan Stanley | 1.882 | 116 | CSW Industrials Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.079 |
| 60 | CorVel Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.640) | 94 | CSW Industrials Inc | Goldman Sachs | 874 |
| 55 | CorVel Corp | Goldman Sachs | (1.503) | (76) | CSX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 91 |
| (2.354) | Coterra Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.061 | (237) | CSX Corp | Morgan Stanley | 275 |
| (2.199) | Coterra Energy Inc | Goldman Sachs | 4.728 | | | | |
| (543) | Coterra Energy Inc | Morgan Stanley | 1.347 | | | | |
| (3.508) | Coty Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.193 | | | | |
| (5.740) | Coty Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.588 | | | | |
| (6.887) | Coty Inc 'A' | Morgan Stanley | 2.789 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (91) | CTS Corp | Bank of America | | (28) | Denbury Inc | Goldman Sachs | 20 |
| | | Merrill Lynch | (244) | 805 | Denny's Corp | Bank of America | |
| (255) | CTS Corp | Goldman Sachs | (650) | | | Merrill Lynch | 242 |
| 62 | CubeSmart (REIT) | Bank of America | | 458 | Denny's Corp | Goldman Sachs | 137 |
| | | Merrill Lynch | (63) | (72) | DENTSPLY SIRONA Inc | Bank of America | |
| 398 | CubeSmart (REIT) | Morgan Stanley | (40) | | | Merrill Lynch | 360 |
| (521) | Cullen/Frost Bankers Inc | Bank of America | | (167) | DENTSPLY SIRONA Inc | Goldman Sachs | 835 |
| | | Merrill Lynch | (1.567) | 178 | Designer Brands Inc 'A' | Bank of America | |
| (173) | Cullen/Frost Bankers Inc | Goldman Sachs | 5 | | | Merrill Lynch | (198) |
| (218) | Cullen/Frost Bankers Inc | Morgan Stanley | 234 | 141 | Designer Brands Inc 'A' | Goldman Sachs | (157) |
| 70 | Cummins Inc | Bank of America | | 220 | Devon Energy Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (471) | | | Merrill Lynch | (301) |
| 26 | Cummins Inc | Morgan Stanley | (165) | 568 | Devon Energy Corp | Goldman Sachs | (778) |
| 161 | Curtiss-Wright Corp | Bank of America | | 160 | Devon Energy Corp | Morgan Stanley | (477) |
| | | Merrill Lynch | (1.087) | 28 | Dexcom Inc | Bank of America | |
| 183 | Curtiss-Wright Corp | Goldman Sachs | (1.235) | | | Merrill Lynch | 24 |
| 133 | Curtiss-Wright Corp | Morgan Stanley | (899) | (1.031) | Diamond Offshore Drilling Inc | Bank of America | |
| (742) | Cushman & Wakefield Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 608 |
| | | Merrill Lynch | (156) | 447 | Diamondback Energy Inc | Bank of America | |
| (1.939) | Cushman & Wakefield Plc | Goldman Sachs | (407) | | | Merrill Lynch | (840) |
| 1.746 | CVS Health Corp | Goldman Sachs | (2.740) | 287 | Diamondback Energy Inc | Goldman Sachs | (540) |
| 2.360 | CVS Health Corp | Morgan Stanley | (5.317) | 107 | Diamondback Energy Inc | Morgan Stanley | (575) |
| (150) | Cymbabay Therapeutics Inc | Bank of America | | 2.917 | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 216 | | | Merrill Lynch | (992) |
| (258) | Cymbabay Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 234 | 1.334 | DiamondRock Hospitality Co (REIT) | Goldman Sachs | (454) |
| (585) | Cytek Biosciences Inc | Bank of America | | (326) | DICE Therapeutics Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (464) | | | Merrill Lynch | 1.014 |
| (920) | Cytek Biosciences Inc | Goldman Sachs | (481) | (223) | DICE Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 694 |
| (47) | Cytokinetics Inc | Bank of America | | 264 | Dick's Sporting Goods Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 48 | | | Merrill Lynch | (31) |
| (132) | Cytokinetics Inc | Goldman Sachs | 136 | 129 | Dick's Sporting Goods Inc | Goldman Sachs | (146) |
| (56) | Cytokinetics Inc | Morgan Stanley | 158 | 157 | Dick's Sporting Goods Inc | Morgan Stanley | 339 |
| 600 | Dana Inc | Bank of America | | 659 | Digi International Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (474) | | | Merrill Lynch | 2.610 |
| 1.543 | Dana Inc | Goldman Sachs | (1.250) | 620 | Digi International Inc | Goldman Sachs | 2.455 |
| 407 | Danaher Corp | Goldman Sachs | (899) | (45) | Digital Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America | |
| 528 | Danaher Corp | Morgan Stanley | (3.458) | | | Merrill Lynch | (103) |
| (115) | Datadog Inc 'A' | Bank of America | | (2.726) | Digital Turbine Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (739) | | | Merrill Lynch | 9.459 |
| (587) | Datadog Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.540) | (2.227) | Digital Turbine Inc | Goldman Sachs | 7.218 |
| (1.208) | Datadog Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.274) | 18 | DigitalBridge Group Inc | Bank of America | |
| 462 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 29 |
| | | Merrill Lynch | (896) | 588 | DigitalBridge Group Inc | Goldman Sachs | 935 |
| 426 | Dave & Buster's Entertainment Inc | Goldman Sachs | (826) | 533 | DigitalOcean Holdings Inc | Bank of America | |
| 503 | Deciphera Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 2.319 |
| | | Merrill Lynch | (349) | 896 | DigitalOcean Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.864 |
| 792 | Deciphera Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (561) | 411 | Dime Community Bancshares Inc | Bank of America | |
| 187 | Deckers Outdoor Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 247 |
| | | Merrill Lynch | (2.927) | 445 | Dime Community Bancshares Inc | Goldman Sachs | 316 |
| 174 | Deckers Outdoor Corp | Goldman Sachs | (2.723) | (66) | Dine Brands Global Inc | Bank of America | |
| 123 | Deckers Outdoor Corp | Morgan Stanley | 2.419 | | | Merrill Lynch | 299 |
| (677) | Definitive Healthcare Corp | Bank of America | | (550) | Dine Brands Global Inc | Goldman Sachs | 2.492 |
| | | Merrill Lynch | (112) | (263) | Diodes Inc | Bank of America | |
| 204 | Delek US Holdings Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (563) |
| | | Merrill Lynch | (173) | (112) | Diodes Inc | Goldman Sachs | (240) |
| 239 | Delek US Holdings Inc | Goldman Sachs | (197) | (59) | Diodes Inc | Morgan Stanley | 221 |
| (456) | Dell Technologies Inc 'C' | Bank of America | | 31 | Discover Financial Services | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (502) | | | Merrill Lynch | 116 |
| (185) | Dell Technologies Inc 'C' | Goldman Sachs | (204) | 36 | DMC Global Inc | Goldman Sachs | (27) |
| (233) | Dell Technologies Inc 'C' | Morgan Stanley | 352 | (871) | DocGo Inc | Bank of America | |
| (370) | Deluxe Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (215) |
| | | Merrill Lynch | (81) | (1.797) | DocGo Inc | Goldman Sachs | (407) |
| (299) | Deluxe Corp | Goldman Sachs | (81) | 63 | DocuSign Inc | Bank of America | |
| (488) | Denali Therapeutics Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 309 |
| | | Merrill Lynch | 930 | 255 | DocuSign Inc | Morgan Stanley | 140 |
| (508) | Denali Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 789 | (89) | Dollar General Corp | Bank of America | |
| (24) | Denbury Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 118 |
| | | Merrill Lynch | 17 | (83) | Dollar General Corp | Goldman Sachs | 1.014 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|----------------------------------|---|---|---|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (144) | Dollar General Corp | Morgan Stanley | 750 | 5.407 | Duckhorn Portfolio Inc | Goldman Sachs | (5.836) |
| (120) | Dollar Tree Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.139 | 227 | Ducommun Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.696) |
| (57) | Dollar Tree Inc | Goldman Sachs | (49) | 428 | Ducommun Inc | Goldman Sachs | (3.197) |
| (92) | Dollar Tree Inc | Morgan Stanley | 2.068 | (38) | Duke Energy Corp | Morgan Stanley | 29 |
| (685) | Dominion Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.115 | (948) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 673 |
| (378) | Dominion Energy Inc | Goldman Sachs | 1.841 | (849) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Goldman Sachs | 603 |
| (465) | Dominion Energy Inc | Morgan Stanley | 884 | (989) | Dun & Bradstreet Holdings Inc | Morgan Stanley | 593 |
| 75 | Domino's Pizza Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.193) | (46) | Duolingo Inc | Bank of America Merrill Lynch | (410) |
| 257 | Domino's Pizza Inc | Goldman Sachs | (4.089) | (531) | Duolingo Inc | Morgan Stanley | 2.012 |
| 205 | Domino's Pizza Inc | Morgan Stanley | (3.479) | 1.481 | DuPont de Nemours Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.051 |
| 424 | Domo Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (407) | 771 | DuPont de Nemours Inc | Goldman Sachs | 1.588 |
| 197 | Domo Inc 'B' | Goldman Sachs | (189) | 2.375 | DuPont de Nemours Inc | Morgan Stanley | 1.425 |
| 104 | Donaldson Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (394) | 14 | DXP Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | 22 |
| 78 | Donaldson Co Inc | Goldman Sachs | (296) | 341 | DXP Enterprises Inc | Goldman Sachs | 525 |
| 37 | Donaldson Co Inc | Morgan Stanley | (164) | 210 | Dycom Industries Inc | Goldman Sachs | 1.012 |
| 921 | Donegal Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 262 | (237) | Dynatrace Inc | Bank of America Merrill Lynch | (988) |
| (327) | Donnelley Financial Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10 | (1.660) | Dynatrace Inc | Goldman Sachs | (6.922) |
| (388) | Donnelley Financial Solutions Inc | Goldman Sachs | 12 | (362) | Dynatrace Inc | Morgan Stanley | (576) |
| (516) | DoorDash Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.017 | (1.582) | Dynavax Technologies Corp | Bank of America Merrill Lynch | 201 |
| (1.288) | DoorDash Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.537 | (1.283) | Dynavax Technologies Corp | Goldman Sachs | 131 |
| (178) | DoorDash Inc 'A' | Morgan Stanley | 249 | 619 | Dyne Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (477) |
| 1.114 | Dorian LPG Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.983 | (2.312) | Dynex Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (532) |
| 1.271 | Dorian LPG Ltd | Goldman Sachs | 2.262 | (3.308) | Dynex Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (761) |
| (64) | Dorman Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | 80 | (4.105) | E2open Parent Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.135) |
| (390) | Dorman Products Inc | Goldman Sachs | 488 | (6.121) | E2open Parent Holdings Inc | Goldman Sachs | (3.183) |
| (144) | Douglas Dynamics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (140) | (284) | Eagle Bulk Shipping Inc | Bank of America Merrill Lynch | 601 |
| (191) | Douglas Dynamics Inc | Goldman Sachs | (153) | (401) | Eagle Bulk Shipping Inc | Goldman Sachs | 838 |
| (887) | Douglas Elliman Inc | Bank of America Merrill Lynch | (53) | (82) | Eagle Materials Inc | Bank of America Merrill Lynch | (316) |
| (2.929) | Douglas Elliman Inc | Goldman Sachs | (176) | 250 | Eagle Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (59) |
| (889) | Douglas Emmett Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (846) | 616 | Eagle Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (145) |
| (578) | Douglas Emmett Inc (REIT) | Goldman Sachs | (200) | 483 | Earthstone Energy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (299) |
| 23 | Dover Corp | Bank of America Merrill Lynch | (105) | 53 | Earthstone Energy Inc 'A' | Goldman Sachs | (33) |
| 372 | Dover Corp | Goldman Sachs | (1.625) | (462) | East West Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.132) |
| 154 | Dover Corp | Morgan Stanley | (396) | (2.852) | Easterly Government Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 234 |
| (1.246) | Doximity Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 4.187 | 212 | Eastern Bankshares Inc | Goldman Sachs | (87) |
| (1.071) | Doximity Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.092 | 441 | Eastman Chemical Co | Morgan Stanley | (2.099) |
| (326) | DR Horton Inc | Bank of America Merrill Lynch | 971 | 5.285 | eBay Inc | Morgan Stanley | (7.346) |
| (404) | DR Horton Inc | Goldman Sachs | 1.204 | (1.816) | Ebiz Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7.791) |
| (33) | DraftKings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1 | 2.333 | EchoStar Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 560 |
| (2.273) | DraftKings Inc 'A' | Morgan Stanley | 4.000 | 2.777 | EchoStar Corp 'A' | Goldman Sachs | 666 |
| (64) | Dril-Quip Inc | Goldman Sachs | 38 | 696 | Ecovyst Inc | Bank of America Merrill Lynch | (244) |
| (892) | Driven Brands Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.113 | 3.679 | Ecovyst Inc | Goldman Sachs | (1.288) |
| (1.072) | Driven Brands Holdings Inc | Goldman Sachs | 3.741 | (364) | Edgewell Personal Care Co | Goldman Sachs | 1.460 |
| 1.054 | Dropbox Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 285 | (511) | Edison International | Bank of America Merrill Lynch | 2.979 |
| 593 | Dropbox Inc 'A' | Goldman Sachs | 160 | (1.245) | Edison International | Goldman Sachs | 7.258 |
| 660 | Dropbox Inc 'A' | Morgan Stanley | 264 | (451) | Edison International | Morgan Stanley | 573 |
| (164) | DTE Midstream LLC | Bank of America Merrill Lynch | 394 | 792 | Editas Medicine Inc | Bank of America Merrill Lynch | (768) |
| (277) | DTE Midstream LLC | Goldman Sachs | 665 | | | | |
| 5.053 | Duckhorn Portfolio Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.734) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|--|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.617 | Editas Medicine Inc | Goldman Sachs | (1.568) | 256 | EnPro Industries Inc | Bank of America | |
| 37 | Edwards Lifesciences Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.622 |
| | | Merrill Lynch | (273) | 241 | EnPro Industries Inc | Goldman Sachs | 1.588 |
| 326 | Edwards Lifesciences Corp | Morgan Stanley | (2.487) | 28 | Ensign Group Inc | Bank of America | |
| (143) | Elastic NV | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (116) |
| | | Merrill Lynch | (1.644) | 62 | Ensign Group Inc | Goldman Sachs | (257) |
| (360) | Elastic NV | Goldman Sachs | (4.140) | 82 | Ensign Group Inc | Morgan Stanley | (268) |
| (139) | Elastic NV | Morgan Stanley | (986) | (964) | Entegris Inc | Bank of America | |
| 577 | Electronic Arts Inc | Goldman Sachs | 916 | | | Merrill Lynch | (14.875) |
| 1.292 | Electronic Arts Inc | Morgan Stanley | 1.796 | (742) | Entegris Inc | Goldman Sachs | (11.449) |
| 193 | Elevance Health Inc | Goldman Sachs | (1.450) | (1.265) | Entegris Inc | Morgan Stanley | (13.080) |
| 55 | Elevance Health Inc | Morgan Stanley | (408) | (215) | Enterprise Financial Services Corp | Bank of America | |
| 1.218 | Elme Communities (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (563) |
| | | Merrill Lynch | (1.352) | (278) | Enterprise Financial Services Corp | Goldman Sachs | (728) |
| 2.497 | Elme Communities (REIT) | Goldman Sachs | (2.772) | 177 | Envista Holdings Corp | Bank of America | |
| (24) | Embeckta Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (298) |
| | | Merrill Lynch | (4) | 1.162 | Envista Holdings Corp | Goldman Sachs | (2.463) |
| (108) | Embeckta Corp | Goldman Sachs | 77 | 653 | Envista Holdings Corp | Morgan Stanley | (2.364) |
| (107) | EMCOR Group Inc | Bank of America | | 199 | EOG Resources Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (500) | | | Merrill Lynch | (760) |
| (471) | EMCOR Group Inc | Morgan Stanley | (2.525) | 225 | EOG Resources Inc | Goldman Sachs | (860) |
| 1.070 | Emergent BioSolutions Inc | Bank of America | | 1.342 | EOG Resources Inc | Morgan Stanley | (8.092) |
| | | Merrill Lynch | (963) | 93 | EPAM Systems Inc | Goldman Sachs | 1.854 |
| 1.878 | Emergent BioSolutions Inc | Goldman Sachs | (1.690) | 11 | EPAM Systems Inc | Morgan Stanley | (77) |
| (158) | Emerson Electric Co | Bank of America | | 168 | ePlus Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 324 | | | Merrill Lynch | 268 |
| (1.230) | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America | | 879 | EPR Properties (REIT) | Goldman Sachs | (457) |
| | | Merrill Lynch | (590) | (1.011) | EQRx Inc | Goldman Sachs | 71 |
| (1.718) | Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (825) | (1.299) | Equitable Holdings Inc | Bank of America | |
| 45 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.078) |
| | | Merrill Lynch | (93) | (515) | Equitable Holdings Inc | Goldman Sachs | (427) |
| 279 | Enanta Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (575) | (4.664) | Equitable Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.959 |
| (61) | Encompass Health Corp | Bank of America | | 3.708 | Equitrans Midstream Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (9) | | | Merrill Lynch | 10.419 |
| (737) | Encompass Health Corp | Morgan Stanley | 663 | 971 | Equitrans Midstream Corp | Goldman Sachs | 2.729 |
| (34) | Encore Capital Group Inc | Bank of America | | 42 | Equity Bancshares Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 29 | | | Merrill Lynch | 58 |
| (878) | Encore Capital Group Inc | Goldman Sachs | 746 | (1.107) | Equity Commonwealth (REIT) | Bank of America | |
| (70) | Encore Wire Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (39) |
| | | Merrill Lynch | 264 | (771) | Equity Commonwealth (REIT) | Goldman Sachs | (39) |
| (755) | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.321 | 202 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| (1.772) | Endeavor Group Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 992 | 538 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | (1.020) |
| (82) | Energizer Holdings Inc | Bank of America | | 609 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.717) |
| | | Merrill Lynch | 207 | (42) | Erie Indemnity Co 'A' | Morgan Stanley | (1.084) |
| (603) | Energizer Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.526 | | | Bank of America | |
| 947 | Energy Recovery Inc | Bank of America | | (36) | Erie Indemnity Co 'A' | Merrill Lynch | 525 |
| | | Merrill Lynch | (161) | (345) | Esab Corp | Morgan Stanley | 363 |
| 1.260 | Energy Recovery Inc | Goldman Sachs | (214) | | | Bank of America | |
| (447) | Energy Vault Holdings Inc | Bank of America | | (319) | Esab Corp | Merrill Lynch | 345 |
| | | Merrill Lynch | (76) | 53 | ESCO Technologies Inc | Goldman Sachs | 319 |
| 434 | Enerpac Tool Group Corp | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 612 | 148 | ESCO Technologies Inc | Merrill Lynch | (269) |
| 928 | Enerpac Tool Group Corp | Goldman Sachs | 1.308 | (1.148) | ESS Tech Inc | Goldman Sachs | (752) |
| (262) | EnerSys | Bank of America | | 1.517 | Essent Group Ltd | Goldman Sachs | (333) |
| | | Merrill Lynch | (3.830) | (436) | Essential Properties Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 743 |
| (446) | EnerSys | Goldman Sachs | (6.366) | (334) | Establishment Labs Holdings Inc | Goldman Sachs | 423 |
| (564) | Enhabit Inc | Goldman Sachs | 664 | (41) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Bank of America | |
| 637 | Ennis Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 1.406 |
| | | Merrill Lynch | (153) | | | Bank of America | |
| 64 | Ennis Inc | Goldman Sachs | (15) | (39) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Merrill Lynch | 261 |
| 990 | Enova International Inc | Bank of America | | (35) | Estee Lauder Cos Inc 'A' | Goldman Sachs | 462 |
| | | Merrill Lynch | 4.203 | 694 | Ethan Allen Interiors Inc | Morgan Stanley | 174 |
| 475 | Enova International Inc | Goldman Sachs | 1.999 | | | Bank of America | |
| 388 | Enovis Corp | Goldman Sachs | (1.750) | 1.420 | Ethan Allen Interiors Inc | Merrill Lynch | (1.360) |
| 567 | Enovis Corp | Morgan Stanley | (2.211) | | | Goldman Sachs | (2.783) |
| (2.880) | Enovix Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (403) | | | | |
| (1.016) | Enovix Corp | Goldman Sachs | (142) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 201 | Etsy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.079) | 140 | Expensify Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 111 |
| 84 | Etsy Inc | Goldman Sachs | (1.287) | 203 | Expensify Inc 'A' | Goldman Sachs | 160 |
| 196 | Etsy Inc | Morgan Stanley | (1.468) | 277 | Exponent Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.665 |
| 2.099 | Euronav NV | Bank of America Merrill Lynch | (1.616) | 682 | Exponent Inc | Goldman Sachs | 4.099 |
| 2.464 | Euronav NV | Goldman Sachs | (1.897) | (119) | Expro Group Holdings NV | Bank of America Merrill Lynch | 170 |
| 1.798 | Euronav NV | Morgan Stanley | (2.014) | (848) | Expro Group Holdings NV | Goldman Sachs | 1.213 |
| (47) | Euronet Worldwide Inc | Bank of America Merrill Lynch | 83 | (59) | Extra Space Storage Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 463 |
| (71) | Euronet Worldwide Inc | Goldman Sachs | 126 | 264 | Extreme Networks Inc | Bank of America Merrill Lynch | 892 |
| (104) | Euronet Worldwide Inc | Morgan Stanley | 1.071 | 3.530 | Extreme Networks Inc | Goldman Sachs | 11.931 |
| (608) | European Wax Center Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (59) | 20 | Exxon Mobil Corp | Bank of America Merrill Lynch | (100) |
| 1.837 | Eventbrite Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 496 | 125 | Exxon Mobil Corp | Goldman Sachs | (309) |
| 1.053 | Eventbrite Inc 'A' | Goldman Sachs | 284 | 1.058 | Exxon Mobil Corp | Morgan Stanley | (2.591) |
| 329 | Everbridge Inc | Bank of America Merrill Lynch | (500) | 1.328 | EZCORP Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (286) |
| 355 | Everbridge Inc | Goldman Sachs | (461) | 457 | EZCORP Inc 'A' | Goldman Sachs | (78) |
| (1.825) | EverCommerce Inc | Bank of America Merrill Lynch | (292) | 113 | F5 Inc | Bank of America Merrill Lynch | 940 |
| (93) | EverCommerce Inc | Goldman Sachs | (15) | 101 | F5 Inc | Goldman Sachs | 840 |
| 55 | Evercore Inc 'A' | Goldman Sachs | 69 | 105 | F5 Inc | Morgan Stanley | 369 |
| (186) | Evergy Inc | Goldman Sachs | 841 | 73 | Fair Isaac Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.224 |
| (105) | Evergy Inc | Morgan Stanley | 197 | 88 | Fair Isaac Corp | Goldman Sachs | 2.981 |
| 711 | Everi Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (873) | 66 | Fair Isaac Corp | Morgan Stanley | 979 |
| 2.673 | Everi Holdings Inc | Goldman Sachs | (3.504) | (4.943) | Farfetch Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (4.325) |
| (46) | Eversource Energy | Bank of America Merrill Lynch | 116 | (5.126) | Farfetch Ltd 'A' | Goldman Sachs | (4.485) |
| (87) | Eversource Energy | Morgan Stanley | 301 | (33) | Farmers National Banc Corp | Bank of America Merrill Lynch | (25) |
| 1.097 | EVERTEC Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.251) | (93) | Farmers National Banc Corp | Goldman Sachs | (29) |
| 1.781 | EVERTEC Inc | Goldman Sachs | (2.030) | (3.174) | Farmland Partners Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.613) |
| (435) | Evolent Health Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.688 | (1.191) | Farmland Partners Inc (REIT) | Goldman Sachs | (691) |
| (445) | Evolent Health Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.750 | 259 | Fastenal Co | Bank of America Merrill Lynch | (90) |
| (814) | Evolus Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.009 | 40 | Fastenal Co | Goldman Sachs | (51) |
| (927) | Evolus Inc | Goldman Sachs | 1.149 | 138 | Fastenal Co | Morgan Stanley | (158) |
| (198) | Evolv Technologies Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (69) | (700) | Fastly Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.463) |
| (2.885) | Evolv Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.010) | (653) | Fastly Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.952) |
| 933 | EW Scripps Co 'A' | Goldman Sachs | 532 | 1.607 | Fate Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (530) |
| (849) | Excelerate Energy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.779 | 2.621 | Fate Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (865) |
| 694 | Exelixis Inc | Bank of America Merrill Lynch | (278) | 106 | FB Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 166 |
| 826 | Exelixis Inc | Goldman Sachs | (330) | 182 | FB Financial Corp | Goldman Sachs | 286 |
| 1.017 | Exelixis Inc | Morgan Stanley | (681) | (77) | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 136 |
| (208) | Exelon Corp | Goldman Sachs | 319 | (256) | Federal Agricultural Mortgage Corp 'C' | Goldman Sachs | 445 |
| (1.694) | Exelon Corp | Morgan Stanley | 1.516 | (725) | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 3.458 |
| (64) | ExlService Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 75 | (67) | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Goldman Sachs | 320 |
| (14) | ExlService Holdings Inc | Goldman Sachs | 16 | (465) | Federal Realty Investment Trust (REIT) | Morgan Stanley | 1.404 |
| (29) | ExlService Holdings Inc | Morgan Stanley | 144 | (85) | Federal Signal Corp | Bank of America Merrill Lynch | 31 |
| 1.969 | eXp World Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.096 | (244) | Federal Signal Corp | Goldman Sachs | 90 |
| 2.264 | eXp World Holdings Inc | Goldman Sachs | 4.709 | (940) | Federated Hermes Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.688 |
| (52) | Expedia Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 94 | (291) | Federated Hermes Inc | Goldman Sachs | 832 |
| (41) | Expedia Group Inc | Goldman Sachs | 100 | 792 | FibroGen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (420) |
| (114) | Expedia Group Inc | Morgan Stanley | 139 | | | | |
| (224) | Expeditors International of Washington Inc | Bank of America Merrill Lynch | 523 | | | | |
| (49) | Expeditors International of Washington Inc | Goldman Sachs | 147 | | | | |
| (87) | Expeditors International of Washington Inc | Morgan Stanley | 369 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 908 | FibroGen Inc | Goldman Sachs | (329) | 734 | First of Long Island Corp | Goldman Sachs | 462 |
| (1.072) | Fidelity National Financial Inc | Goldman Sachs | (75) | 18 | First Watch Restaurant Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 7 |
| (923) | Fidelity National Financial Inc | Morgan Stanley | 295 | (99) | FirstCash Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 458 |
| 765 | Fidelity National Information Services Inc | Bank of America Merrill Lynch | (878) | (254) | FirstCash Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.176 |
| 1.722 | Fidelity National Information Services Inc | Goldman Sachs | (2.882) | (2.472) | FirstEnergy Corp | Morgan Stanley | 2.101 |
| 727 | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley | (2.763) | (309) | Fiserv Inc | Goldman Sachs | 2.682 |
| (709) | Fifth Third Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (188) | (350) | Fiserv Inc | Morgan Stanley | 2.975 |
| (1.838) | Fifth Third Bancorp | Goldman Sachs | (800) | 35 | Five Below Inc | Bank of America Merrill Lynch | (929) |
| (995) | Fifth Third Bancorp | Morgan Stanley | 498 | 28 | Five Below Inc | Goldman Sachs | (743) |
| (1.055) | Figs Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (127) | 13 | Five Below Inc | Morgan Stanley | (177) |
| (2.364) | Figs Inc 'A' | Goldman Sachs | (284) | 674 | Fiverr International Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.550) |
| (181) | First Advantage Corp | Bank of America Merrill Lynch | (33) | 861 | Fiverr International Ltd | Goldman Sachs | (2.032) |
| (830) | First Advantage Corp | Goldman Sachs | (137) | (34) | FleetCor Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 122 |
| (208) | First American Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 239 | (80) | FleetCor Technologies Inc | Goldman Sachs | 288 |
| (205) | First American Financial Corp | Goldman Sachs | 236 | (150) | Floor & Decor Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | (279) |
| (960) | First Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (2.271) | 413 | Flowers Foods Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.392) |
| (1.514) | First Bancorp | Goldman Sachs | (4.239) | 450 | Flowers Foods Inc | Goldman Sachs | (1.516) |
| (327) | First BanCorp | Bank of America Merrill Lynch | (31) | (800) | Fluence Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 304 |
| (395) | First BanCorp | Goldman Sachs | (57) | 213 | Fluor Corp | Goldman Sachs | 11 |
| 589 | First Bancshares Inc | Goldman Sachs | 1.048 | 745 | Fluor Corp | Morgan Stanley | (678) |
| 1.024 | First Busey Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.516 | 392 | Flushing Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 800 |
| 377 | First Busey Corp | Goldman Sachs | 558 | 823 | Flushing Financial Corp | Goldman Sachs | 1.679 |
| (13) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 50 | (281) | Flywire Corp | Bank of America Merrill Lynch | 531 |
| (4) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Goldman Sachs | 44 | (71) | FMC Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2 |
| (71) | First Citizens BancShares Inc 'A' | Morgan Stanley | 3.179 | (163) | FMC Corp | Goldman Sachs | 266 |
| (55) | First Commonwealth Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1 | (2.526) | FNB Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.617) |
| (36) | First Commonwealth Financial Corp | Goldman Sachs | (33) | (215) | FNB Corp | Morgan Stanley | 19 |
| (300) | First Financial Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (129) | 983 | Foot Locker Inc | Bank of America Merrill Lynch | (319) |
| (481) | First Financial Bankshares Inc | Goldman Sachs | (207) | 504 | Foot Locker Inc | Goldman Sachs | (220) |
| 156 | First Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 70 | 9.146 | Ford Motor Co | Bank of America Merrill Lynch | 5.671 |
| 104 | First Financial Corp | Goldman Sachs | 47 | 2.549 | Ford Motor Co | Morgan Stanley | 1.606 |
| 483 | First Foundation Inc | Goldman Sachs | 68 | (183) | FormFactor Inc | Bank of America Merrill Lynch | (439) |
| 383 | First Hawaiian Inc | Bank of America Merrill Lynch | 134 | (374) | FormFactor Inc | Goldman Sachs | (898) |
| 775 | First Hawaiian Inc | Goldman Sachs | 271 | 8 | Forrester Research Inc | Bank of America Merrill Lynch | 25 |
| (682) | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 314 | 476 | Forrester Research Inc | Goldman Sachs | 1.504 |
| (137) | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 63 | 236 | Fortinet Inc | Bank of America Merrill Lynch | 21 |
| (146) | First Industrial Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (39) | 49 | Fortinet Inc | Morgan Stanley | (43) |
| 999 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 383 | (217) | Forward Air Corp | Bank of America Merrill Lynch | 63 |
| 911 | First Interstate BancSystem Inc 'A' | Goldman Sachs | 131 | (349) | Forward Air Corp | Goldman Sachs | 101 |
| (170) | First Merchants Corp | Bank of America Merrill Lynch | (224) | (788) | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 284 |
| (748) | First Merchants Corp | Goldman Sachs | (987) | (963) | Four Corners Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 347 |
| 537 | First of Long Island Corp | Bank of America Merrill Lynch | 338 | 132 | Fox Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 46 |
| | | | | 4.531 | Fox Corp 'A' | Morgan Stanley | 227 |
| | | | | 1.283 | Fox Corp 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 744 |
| | | | | 669 | Fox Corp 'B' | Goldman Sachs | 388 |
| | | | | 1.536 | Fox Corp 'B' | Morgan Stanley | 369 |
| | | | | (36) | Fox Factory Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 333 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|----------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 392 | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 227 | 356 | GATX Corp | Goldman Sachs | 3.412 |
| 13 | Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 8 | (968) | GE Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.949) |
| 419 | Franklin Covey Co | Bank of America Merrill Lynch | 88 | (777) | GE Healthcare Inc | Goldman Sachs | (3.170) |
| 608 | Franklin Covey Co | Goldman Sachs | 128 | (1.519) | Gen Digital Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.557) |
| 472 | Franklin Electric Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 128 | (2.324) | Gen Digital Inc | Goldman Sachs | (2.382) |
| 315 | Franklin Electric Co Inc | Goldman Sachs | 57 | (1.434) | Gen Digital Inc | Morgan Stanley | (538) |
| 1.204 | Freeport-McMoRan Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.956) | 1.433 | Genco Shipping & Trading Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.892) |
| 1.738 | Freeport-McMoRan Inc | Goldman Sachs | (2.679) | 718 | Genco Shipping & Trading Ltd | Goldman Sachs | (948) |
| 2.230 | Freeport-McMoRan Inc | Morgan Stanley | (2.244) | 127 | General Electric Co | Bank of America Merrill Lynch | (75) |
| (250) | Fresh Del Monte Produce Inc | Bank of America Merrill Lynch | 93 | 335 | General Electric Co | Goldman Sachs | (430) |
| (355) | Freshpet Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.765 | 427 | General Electric Co | Morgan Stanley | (1.635) |
| (392) | Freshpet Inc | Goldman Sachs | 3.054 | 399 | General Motors Co | Morgan Stanley | 129 |
| (3.391) | Freshworks Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.763 | 690 | Genesco Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.296) |
| (2.890) | FREYR Battery SA | Bank of America Merrill Lynch | 514 | 627 | Genesco Inc | Goldman Sachs | (3.951) |
| (284) | FREYR Battery SA | Goldman Sachs | 57 | 696 | Gentex Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.538) |
| 1.795 | Frontdoor Inc | Goldman Sachs | (1.778) | 380 | Gentex Corp | Goldman Sachs | (840) |
| (868) | Frontier Communications Parent Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.535 | 2.034 | Gentex Corp | Morgan Stanley | (3.356) |
| (546) | Frontier Communications Parent Inc | Goldman Sachs | 1.594 | 132 | Gentherm Inc | Bank of America Merrill Lynch | (319) |
| (1.666) | Frontier Communications Parent Inc | Morgan Stanley | 1.166 | 114 | Gentherm Inc | Goldman Sachs | (266) |
| 1.926 | Frontier Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 501 | (5.452) | Genworth Financial Inc 'A' | Goldman Sachs | (55) |
| 748 | Frontline Ltd | Goldman Sachs | 1.816 | 934 | GEO Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.074) |
| 125 | FRP Holdings Inc | Goldman Sachs | (17) | 592 | GEO Group Inc | Goldman Sachs | (681) |
| 558 | FTAI Aviation Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (407) | (215) | German American Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (290) |
| 181 | FTAI Aviation Ltd | Goldman Sachs | (132) | (130) | German American Bancorp Inc | Goldman Sachs | (176) |
| 110 | FTI Consulting Inc | Morgan Stanley | 561 | (337) | Getty Realty Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (121) |
| (1.560) | FuelCell Energy Inc | Goldman Sachs | 445 | (113) | Getty Realty Corp (REIT) | Goldman Sachs | (41) |
| (1.294) | Fulcrum Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.061 | 247 | Gibraltar Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (361) |
| (1.028) | Fulcrum Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 843 | 359 | Gibraltar Industries Inc | Goldman Sachs | (524) |
| (157) | Fulgent Genetics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 25 | (218) | G-III Apparel Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 94 |
| (31) | Fulgent Genetics Inc | Goldman Sachs | 2 | (212) | G-III Apparel Group Ltd | Goldman Sachs | 91 |
| 607 | Fulton Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 304 | 222 | Gilead Sciences Inc | Morgan Stanley | (457) |
| 1.122 | Fulton Financial Corp | Goldman Sachs | 561 | (360) | Gittlab Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.922) |
| (1.096) | Funko Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (811) | (1.961) | Gittlab Inc 'A' | Morgan Stanley | (2.822) |
| (2.380) | Funko Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.761) | (720) | Glacier Bancorp Inc | Goldman Sachs | (670) |
| (118) | FutureFuel Corp | Goldman Sachs | 30 | (560) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (151) |
| (195) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 251 | (678) | Gladstone Commercial Corp (REIT) | Goldman Sachs | (150) |
| (259) | Gaming and Leisure Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 268 | 153 | Gladstone Land Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 54 |
| 2.152 | Gap Inc | Bank of America Merrill Lynch | 473 | 501 | Gladstone Land Corp (REIT) | Goldman Sachs | 175 |
| 1.861 | Gap Inc | Morgan Stanley | 372 | (385) | Glaukos Corp | Goldman Sachs | 1.621 |
| 938 | Garmin Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 1.276 | 11 | Global Indemnity Group LLC 'A' | Goldman Sachs | (2) |
| 1.097 | Garmin Ltd | Goldman Sachs | 1.492 | 819 | Global Industrial Co | Bank of America Merrill Lynch | 1.081 |
| 570 | Garmin Ltd | Morgan Stanley | 205 | 460 | Global Industrial Co | Goldman Sachs | 607 |
| 44 | Gartner Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.287 | (401) | Global Medical Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 92 |
| 94 | Gartner Inc | Goldman Sachs | 2.750 | (654) | Global Medical Inc (REIT) | Goldman Sachs | 57 |
| 173 | Gartner Inc | Morgan Stanley | 2.242 | 300 | Global Payments Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.062) |
| (121) | Gates Industrial Corp Plc | Bank of America Merrill Lynch | 236 | 352 | Global Payments Inc | Goldman Sachs | (1.052) |
| (744) | Gates Industrial Corp Plc | Goldman Sachs | 1.451 | 94 | Global Payments Inc | Morgan Stanley | (505) |
| 416 | GATX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4.025 | (31) | Global-e Online Ltd | Goldman Sachs | (124) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------------|----------------------------------|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (632) | Global-e Online Ltd | Morgan Stanley | (310) | 562 | Griffon Corp | Bank of America | |
| (1.930) | Globalstar Inc | Bank of America Merrill Lynch | (212) | 365 | Griffon Corp | Merrill Lynch | 360 |
| 315 | Globus Medical Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.443) | 200 | Group 1 Automotive Inc | Bank of America Merrill Lynch | 234 |
| 476 | Globus Medical Inc 'A' | Goldman Sachs | (2.180) | 222 | Group 1 Automotive Inc | Goldman Sachs | 741 |
| 285 | Globus Medical Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.362) | 1.212 | Guardant Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | 859 |
| 269 | GMS Inc | Goldman Sachs | 823 | 678 | Guardant Health Inc | Goldman Sachs | 1.430 |
| 241 | GoDaddy Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 275 | (382) | Guess? Inc | Bank of America Merrill Lynch | 800 |
| 184 | GoDaddy Inc 'A' | Goldman Sachs | 210 | 412 | Guidewire Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | (321) |
| 96 | GoDaddy Inc 'A' | Morgan Stanley | 26 | 697 | Guidewire Software Inc | Goldman Sachs | 997 |
| (89) | Gogo Inc | Bank of America Merrill Lynch | (7) | 193 | Guidewire Software Inc | Morgan Stanley | 1.687 |
| 658 | Golar LNG Ltd | Goldman Sachs | (1.033) | 170 | Gulfport Energy Corp | Goldman Sachs | 176 |
| 145 | Golar LNG Ltd | Morgan Stanley | (174) | 210 | H&E Equipment Services Inc | Merrill Lynch | 292 |
| 632 | Golden Entertainment Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.838 | 669 | H&E Equipment Services Inc | Goldman Sachs | 642 |
| 157 | Golden Entertainment Inc | Goldman Sachs | 705 | (619) | H&R Block Inc | Bank of America Merrill Lynch | 588 |
| (11) | Goldman Sachs Group Inc | Morgan Stanley | 83 | (100) | H&R Block Inc | Goldman Sachs | 95 |
| 1.199 | GoodRx Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 288 | (220) | H&R Block Inc | Morgan Stanley | (227) |
| 2.072 | GoodRx Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 497 | 585 | Hackett Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 333 |
| 29 | Goosehead Insurance Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (72) | 986 | Hackett Group Inc | Goldman Sachs | 562 |
| 230 | Goosehead Insurance Inc 'A' | Goldman Sachs | (570) | 877 | Hain Celestial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.356) |
| 9.167 | GoPro Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.535 | 757 | Hain Celestial Group Inc | Goldman Sachs | (1.287) |
| 15.572 | GoPro Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.618 | 240 | Halliburton Co | Bank of America Merrill Lynch | (14) |
| (6.999) | Grab Holdings Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.345 | 1.170 | Halliburton Co | Goldman Sachs | (70) |
| (12.897) | Grab Holdings Ltd 'A' | Morgan Stanley | 1.483 | 1.473 | Halliburton Co | Morgan Stanley | (1.738) |
| 547 | Graco Inc | Goldman Sachs | (542) | 244 | Halozyyme Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (315) |
| 596 | Graco Inc | Morgan Stanley | (1.675) | 649 | Halozyyme Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (837) |
| (3.762) | GrafTech International Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (10) | 110 | Halozyyme Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (263) |
| (3.244) | GrafTech International Ltd | Goldman Sachs | 26 | 213 | Hamilton Lane Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 183 |
| (6) | Graham Holdings Co 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 68 | 102 | Hamilton Lane Inc 'A' | Goldman Sachs | 88 |
| (73) | Graham Holdings Co 'B' | Goldman Sachs | 824 | 1.710 | Hancock Whitney Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6.224 |
| (130) | Grand Canyon Education Inc | Bank of America Merrill Lynch | 204 | 410 | Hancock Whitney Corp | Goldman Sachs | 1.492 |
| (724) | Granite Construction Inc | Bank of America Merrill Lynch | 688 | 1.359 | Hanesbrands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 41 |
| (493) | Granite Construction Inc | Goldman Sachs | 468 | 1.901 | Hanesbrands Inc | Goldman Sachs | 57 |
| (1.840) | Graphic Packaging Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | 3.257 | 424 | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.272) |
| (977) | Graphic Packaging Holding Co | Goldman Sachs | 1.729 | 956 | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.868) |
| (1.435) | Graphic Packaging Holding Co | Morgan Stanley | 2.282 | 106 | Hanover Insurance Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (158) |
| 922 | Gray Television Inc | Bank of America Merrill Lynch | (341) | 436 | Hanover Insurance Group Inc | Goldman Sachs | 247 |
| 2.290 | Gray Television Inc | Goldman Sachs | (728) | (79) | HarborOne Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (34) |
| 568 | Great Lakes Dredge & Dock Corp | Bank of America Merrill Lynch | 40 | (1.525) | Harmonic Inc | Goldman Sachs | (1.571) |
| 289 | Great Lakes Dredge & Dock Corp | Goldman Sachs | 20 | 313 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (410) |
| (40) | Great Southern Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (27) | 1.059 | Harmony Biosciences Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.387) |
| (435) | Green Brick Partners Inc | Goldman Sachs | 974 | 554 | Harsco Corp | Bank of America Merrill Lynch | (382) |
| (546) | Greenbrier Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (404) | 1.365 | Harsco Corp | Goldman Sachs | (942) |
| (728) | Greenbrier Cos Inc | Goldman Sachs | (447) | (737) | Hasbro Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.960 |
| (102) | Greif Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 362 | (2.401) | HashiCorp Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (7.779) |
| (368) | Greif Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.306 | | | | |
| (509) | Grid Dynamics Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (417) | | | | |
| (650) | Grid Dynamics Holdings Inc | Goldman Sachs | (533) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|--|---|---|--|-----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (1.096) | HashiCorp Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.578) | 513 | Heidrick & Struggles | | |
| 454 | Haverty Furniture Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (58) | 141 | International Inc Helen of Troy Ltd | Goldman Sachs Bank of America | (254) |
| 787 | Haverty Furniture Cos Inc | Goldman Sachs | (123) | 231 | Helen of Troy Ltd | Merrill Lynch | (23) |
| (696) | Hawaiian Electric Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 856 | (231) | Helios Technologies Inc | Goldman Sachs Bank of America | (37) |
| (2.966) | Hawaiian Electric Industries Inc | Goldman Sachs | 3.640 | (240) | Helios Technologies Inc | Merrill Lynch | 1.178 |
| 2.251 | Hawaiian Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.688 | 757 | Helix Energy Solutions Group Inc | Goldman Sachs Bank of America | 1.224 |
| 3.137 | Hawaiian Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.353 | 3.976 | Helix Energy Solutions Group Inc | Merrill Lynch | (227) |
| (83) | Hawkins Inc | Bank of America Merrill Lynch | (296) | 1.090 | Helmerich & Payne Inc | Goldman Sachs Bank of America | (1.193) |
| (44) | Hawkins Inc | Goldman Sachs | (157) | 1.052 | Helmerich & Payne Inc | Merrill Lynch | 188 |
| (8) | Haynes International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 10 | 1.244 | Helmerich & Payne Inc | Goldman Sachs | 284 |
| (2.051) | Hayward Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 923 | 1.078 | Henry Schein Inc | Morgan Stanley | (1.194) |
| (3.635) | Hayward Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.636 | 751 | Herbalife Ltd | Morgan Stanley Bank of America | (4.441) |
| (95) | HB Fuller Co | Bank of America Merrill Lynch | 146 | 1.411 | Herbalife Ltd | Merrill Lynch | (2.140) |
| (171) | HB Fuller Co | Morgan Stanley | 219 | 297 | Herc Holdings Inc | Goldman Sachs Bank of America | (4.021) |
| 103 | HBT Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 65 | 195 | Herc Holdings Inc | Merrill Lynch | 285 |
| 91 | HBT Financial Inc | Goldman Sachs | 57 | 188 | Herc Holdings Inc | Goldman Sachs | 187 |
| 92 | HCA Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (458) | (401) | Heritage Commerce Corp | Morgan Stanley Bank of America | (530) |
| 21 | HCA Healthcare Inc | Goldman Sachs | (347) | (678) | Heritage Commerce Corp | Merrill Lynch | (88) |
| 107 | HCA Healthcare Inc | Goldman Sachs | (347) | (227) | Heritage-Crystal Clean Inc | Goldman Sachs Bank of America | (149) |
| (19) | HCI Group Inc | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch | (1.718) | (224) | Heritage-Crystal Clean Inc | Merrill Lynch | (20) |
| (130) | HCI Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 64 | (3.858) | Hertz Global Holdings Inc | Goldman Sachs | (20) |
| 236 | Health Catalyst Inc | Goldman Sachs | 441 | (1.550) | Hertz Global Holdings Inc | Bank of America | 579 |
| (983) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch | (5) | 572 | Hewlett Packard Enterprise Co | Morgan Stanley | 188 |
| (1.629) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.574 | (99) | HF Sinclair Corp | Bank of America | 188 |
| (8.904) | Healthcare Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 6.144 | (53) | HF Sinclair Corp | Merrill Lynch | (111) |
| 265 | Healthcare Services Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (175) | (46) | HF Sinclair Corp | Goldman Sachs | (59) |
| 1.353 | Healthcare Services Group Inc | Goldman Sachs | (893) | (113) | Hibbett Inc | Morgan Stanley Bank of America | 43 |
| 193 | HealthEquity Inc | Bank of America Merrill Lynch | (332) | (509) | Hibbett Inc | Bank of America | 1.397 |
| 174 | HealthEquity Inc | Goldman Sachs | (299) | (381) | Highwoods Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs Bank of America | 5.943 |
| (617) | HealthStream Inc | Bank of America Merrill Lynch | 660 | (1.508) | Highwoods Properties Inc (REIT) | Merrill Lynch | 34 |
| (358) | HealthStream Inc | Goldman Sachs | 383 | (399) | Hillenbrand Inc | Goldman Sachs Bank of America | 86 |
| (340) | Heartland Express Inc | Bank of America Merrill Lynch | (116) | (374) | Hillenbrand Inc | Merrill Lynch | (395) |
| (178) | Heartland Express Inc | Goldman Sachs | (61) | (1.903) | Hillman Solutions Corp | Goldman Sachs | (370) |
| 561 | Heartland Financial USA Inc | Bank of America Merrill Lynch | 802 | (902) | Hillman Solutions Corp | Bank of America | (171) |
| 840 | Heartland Financial USA Inc | Goldman Sachs | 912 | (628) | Hilltop Holdings Inc | Goldman Sachs Bank of America | (51) |
| (301) | Hecla Mining Co | Bank of America Merrill Lynch | 3 | (602) | Hilltop Holdings Inc | Merrill Lynch | 554 |
| (2.015) | Hecla Mining Co | Goldman Sachs | 20 | (229) | Hilton Grand Vacations Inc | Goldman Sachs Bank of America | 518 |
| 36 | HEICO Corp | Bank of America Merrill Lynch | (770) | (869) | Hilton Grand Vacations Inc | Merrill Lynch | (435) |
| 52 | HEICO Corp | Goldman Sachs | (1.112) | (524) | Hilton Grand Vacations Inc | Goldman Sachs | (1.651) |
| 48 | HEICO Corp | Morgan Stanley | (1.028) | (16) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Morgan Stanley | 990 |
| 16 | HEICO Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (240) | (66) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 126 |
| 237 | HEICO Corp 'A' | Goldman Sachs | (3.548) | (18) | Hilton Worldwide Holdings Inc | Goldman Sachs | 357 |
| 304 | HEICO Corp 'A' | Morgan Stanley | (4.989) | 187 | Hims & Hers Health Inc | Morgan Stanley | 13 |
| 170 | Heidrick & Struggles International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (84) | 325 | Hims & Hers Health Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (45) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (149) | Hippo Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 435 | (191) | ICF International Inc | Goldman Sachs | 581 |
| (359) | Hippo Holdings Inc | Goldman Sachs | 862 | (204) | Ichor Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (643) |
| (590) | HireRight Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (201) | (1.119) | Ichor Holdings Ltd | Goldman Sachs | (3.525) |
| (742) | HireRight Holdings Corp | Goldman Sachs | (304) | (142) | ICON Plc | Bank of America Merrill Lynch | (193) |
| 318 | HNI Corp | Bank of America Merrill Lynch | (353) | (135) | ICON Plc | Goldman Sachs | (184) |
| 397 | HNI Corp | Goldman Sachs | (441) | (278) | ICON Plc | Morgan Stanley | 2.419 |
| 324 | Hologic Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.247) | 56 | ICU Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.695) |
| 201 | Hologic Inc | Goldman Sachs | (774) | 2 | ICU Medical Inc | Morgan Stanley | (46) |
| 421 | Hologic Inc | Morgan Stanley | (1.309) | 117 | IDACORP Inc | Bank of America Merrill Lynch | (592) |
| (2.267) | Home BancShares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.225) | 244 | IDACORP Inc | Goldman Sachs | (1.235) |
| (2.141) | Home BancShares Inc | Goldman Sachs | (2.162) | 168 | IDACORP Inc | Morgan Stanley | (571) |
| 189 | Honeywell International Inc | Goldman Sachs | (493) | (201) | Ideaya Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | (108) |
| 393 | Honeywell International Inc | Morgan Stanley | (2.055) | (211) | Ideaya Biosciences Inc | Goldman Sachs | (147) |
| (41) | Horace Mann Educators Corp | Bank of America Merrill Lynch | 68 | 87 | IDEXX Laboratories Inc | Goldman Sachs | (2.592) |
| (147) | Horace Mann Educators Corp | Goldman Sachs | 244 | 88 | IDEXX Laboratories Inc | Morgan Stanley | (2.302) |
| 1.997 | Horizon Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.057 | 946 | IDT Corp 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (1.968) |
| 1.701 | Horizon Bancorp Inc | Goldman Sachs | 1.752 | 454 | IDT Corp 'B' | Goldman Sachs | (944) |
| 593 | Hormel Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | (919) | 14 | IES Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14) |
| 610 | Hormel Foods Corp | Goldman Sachs | (946) | (10) | Illumina Inc | Bank of America Merrill Lynch | 107 |
| 414 | Hormel Foods Corp | Morgan Stanley | (339) | (705) | IMAX Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.459 |
| (612) | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 383 | (479) | IMAX Corp | Goldman Sachs | 992 |
| (860) | Hostess Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.006 | 256 | ImmunoGen Inc | Bank of America Merrill Lynch | 69 |
| (884) | Hostess Brands Inc | Goldman Sachs | 1.034 | 1.428 | ImmunoGen Inc | Goldman Sachs | 386 |
| (27) | Houlihan Lokey Inc | Goldman Sachs | 17 | (868) | Immunovant Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.222) |
| (375) | Houlihan Lokey Inc | Morgan Stanley | (124) | (277) | Immunovant Inc | Goldman Sachs | (709) |
| 57 | Howard Hughes Corp | Goldman Sachs | (12) | (86) | Impinj Inc | Bank of America Merrill Lynch | (367) |
| (600) | Howmet Aerospace Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.041 | (179) | Impinj Inc | Goldman Sachs | (764) |
| (1.152) | Howmet Aerospace Inc | Morgan Stanley | 2.431 | 170 | Inari Medical Inc | Bank of America Merrill Lynch | (984) |
| 501 | Hub Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 92 | 220 | Inari Medical Inc | Goldman Sachs | (1.648) |
| 339 | Hub Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 20 | 114 | Inari Medical Inc | Morgan Stanley | (151) |
| (63) | Hubbell Inc | Bank of America Merrill Lynch | (774) | 45 | Incyte Corp | Bank of America Merrill Lynch | (192) |
| (965) | Huntington Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (888) | 599 | Incyte Corp | Goldman Sachs | (2.558) |
| (354) | Huntington Bancshares Inc | Goldman Sachs | (326) | 303 | Incyte Corp | Morgan Stanley | (652) |
| (3.111) | Huntington Bancshares Inc | Morgan Stanley | 156 | (3.226) | Independence Realty Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (1.129) |
| 2.331 | Huntsman Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.030) | (116) | Independent Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | 171 |
| 3.086 | Huntsman Corp | Goldman Sachs | (4.012) | 329 | Independent Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | 201 |
| 720 | Huntsman Corp | Morgan Stanley | (1.145) | 1.032 | Independent Bank Corp | Goldman Sachs | 630 |
| 159 | Huron Consulting Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 46 | (445) | Independent Bank Corp | Goldman Sachs | 654 |
| 157 | Huron Consulting Group Inc | Goldman Sachs | 46 | 431 | Independent Bank Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.082 |
| (53) | Hyatt Hotels Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 286 | 923 | Independent Bank Group Inc | Goldman Sachs | 1.954 |
| (143) | Hyatt Hotels Corp 'A' | Morgan Stanley | 376 | 496 | Infinera Corp | Bank of America Merrill Lynch | 65 |
| (358) | Hyllion Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 20 | 1.149 | Infinera Corp | Goldman Sachs | 138 |
| (1.944) | Hyllion Holdings Corp | Goldman Sachs | 107 | 409 | Informatica Inc 'A' | Goldman Sachs | 855 |
| (263) | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Bank of America Merrill Lynch | 889 | (18) | Ingevity Corp | Bank of America Merrill Lynch | 106 |
| (197) | Hyster-Yale Materials Handling Inc | Goldman Sachs | 666 | (146) | Ingevity Corp | Goldman Sachs | 863 |
| 283 | I3 Verticals Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 345 | (219) | Ingles Markets Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (128) |
| 118 | I3 Verticals Inc 'A' | Goldman Sachs | 144 | (58) | Ingles Markets Inc 'A' | Goldman Sachs | (16) |
| (101) | ICF International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 359 | (156) | Ingredion Inc | Morgan Stanley | 1.084 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (562) | Inhibrx Inc | Bank of America Merrill Lynch | 759 | (1.337) | Interpublic Group of Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.901) |
| (295) | Inhibrx Inc | Goldman Sachs | 451 | (1.684) | Interpublic Group of Cos Inc | Goldman Sachs | (3.567) |
| (57) | Inmode Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 146 | (1.769) | Interpublic Group of Cos Inc | Morgan Stanley | 478 |
| (95) | Inmode Ltd | Morgan Stanley | 264 | (459) | Intra-Cellular Therapies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.111 |
| 8 | Innospec Inc | Bank of America Merrill Lynch | (32) | (719) | Intra-Cellular Therapies Inc | Morgan Stanley | 1.675 |
| 23 | Innoviva Inc | Bank of America Merrill Lynch | 8 | (188) | Intrepid Potash Inc | Bank of America Merrill Lynch | 323 |
| 1.081 | Innoviva Inc | Goldman Sachs | 389 | (133) | Intrepid Potash Inc | Goldman Sachs | 130 |
| (114) | Inogen Inc | Bank of America Merrill Lynch | (25) | (47) | Intuit Inc | Morgan Stanley | 399 |
| (135) | Insight Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.608) | (301) | InvenTrust Properties Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 214 |
| (29) | Insight Enterprises Inc | Goldman Sachs | (345) | (660) | InvenTrust Properties Corp (REIT) | Goldman Sachs | 322 |
| (57) | Insight Enterprises Inc | Morgan Stanley | (178) | 43 | Invesco Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (31) |
| (305) | Insmed Inc | Bank of America Merrill Lynch | 149 | 5.630 | Invesco Ltd | Goldman Sachs | (3.997) |
| (228) | Insmed Inc | Goldman Sachs | 112 | 7.579 | Invesco Ltd | Morgan Stanley | (5.230) |
| 35 | Insperty Inc | Morgan Stanley | (138) | (1.425) | Invesco Mortgage Capital Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 122 |
| 8 | Inspire Medical Systems Inc | Goldman Sachs | (21) | (268) | Invitation Homes Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 91 |
| 19 | Installed Building Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | (166) | (151) | Invitation Homes Inc (REIT) | Morgan Stanley | (15) |
| 118 | Installed Building Products Inc | Goldman Sachs | (1.029) | 843 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.608 |
| (200) | Insteel Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (130) | 64 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 274 |
| (296) | Insteel Industries Inc | Goldman Sachs | (192) | 400 | Ionis Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (76) |
| (43) | Intapp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 42 | (3.568) | IonQ Inc | Bank of America Merrill Lynch | (10.996) |
| (120) | Intapp Inc | Goldman Sachs | 118 | (591) | IonQ Inc | Goldman Sachs | (1.944) |
| (175) | Integer Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (413) | 219 | Iovance Biotherapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 222 |
| (252) | Integer Holdings Corp | Goldman Sachs | (544) | 994 | Iovance Biotherapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.009 |
| 779 | Intel Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.031 | 71 | IQVIA Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 339 |
| 127 | Intel Corp | Morgan Stanley | 371 | 194 | IQVIA Holdings Inc | Goldman Sachs | 927 |
| 150 | Inter Parfums Inc | Goldman Sachs | (1.333) | 100 | IQVIA Holdings Inc | Morgan Stanley | (552) |
| (404) | Interactive Brokers Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (566) | (230) | iRhythm Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.087 |
| (151) | Interactive Brokers Group Inc 'A' | Morgan Stanley | (349) | (202) | iRhythm Technologies Inc | Goldman Sachs | 3.590 |
| 271 | Intercept Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.575) | (462) | iRhythm Technologies Inc | Morgan Stanley | 7.789 |
| 1.731 | Intercept Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (10.057) | (92) | Iridium Communications Inc | Bank of America Merrill Lynch | 172 |
| (207) | InterDigital Inc | Bank of America Merrill Lynch | (124) | (79) | Iridium Communications Inc | Goldman Sachs | 148 |
| (643) | InterDigital Inc | Goldman Sachs | (476) | (262) | Iridium Communications Inc | Morgan Stanley | 506 |
| 350 | Interface Inc | Bank of America Merrill Lynch | (21) | 2.998 | Ironwood Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 794 |
| 882 | Interface Inc | Goldman Sachs | (53) | (139) | iTeos Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 37 |
| 119 | International Bancshares Corp | Bank of America Merrill Lynch | 149 | (136) | Itron Inc | Bank of America Merrill Lynch | (182) |
| 268 | International Bancshares Corp | Goldman Sachs | 335 | (216) | Itron Inc | Goldman Sachs | (289) |
| (83) | International Game Technology Plc | Bank of America Merrill Lynch | 147 | 191 | ITT Inc | Bank of America Merrill Lynch | (999) |
| (860) | International Game Technology Plc | Goldman Sachs | 1.522 | 160 | ITT Inc | Goldman Sachs | (837) |
| (358) | International Game Technology Plc | Morgan Stanley | 616 | 330 | ITT Inc | Morgan Stanley | (1.891) |
| 292 | International Money Express Inc | Bank of America Merrill Lynch | — | (390) | Ivanhoe Electric Inc | Bank of America Merrill Lynch | 702 |
| 458 | International Money Express Inc | Goldman Sachs | — | (171) | Ivanhoe Electric Inc | Goldman Sachs | 308 |
| 1.040 | International Seaways Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.860) | (48) | J & J Snack Foods Corp | Bank of America Merrill Lynch | 312 |
| 312 | International Seaways Inc | Goldman Sachs | (858) | (118) | J & J Snack Foods Corp | Goldman Sachs | 768 |
| | | | | 60 | J M Smucker Co | Bank of America Merrill Lynch | (597) |
| | | | | 54 | J M Smucker Co | Goldman Sachs | (546) |
| | | | | 15 | J M Smucker Co | Morgan Stanley | (64) |
| | | | | 113 | Jabil Inc | Goldman Sachs | 768 |
| | | | | 26 | Jabil Inc | Morgan Stanley | 148 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 164 | Jack Henry & Associates Inc | Bank of America Merrill Lynch | (445) | 237 | Kadant Inc | Goldman Sachs | (1.996) |
| 269 | Jack Henry & Associates Inc | Goldman Sachs | (955) | 203 | Kaiser Aluminum Corp | Bank of America Merrill Lynch | 114 |
| 546 | Jack Henry & Associates Inc | Morgan Stanley | (952) | 135 | Kaiser Aluminum Corp | Goldman Sachs | 76 |
| (304) | Jack in the Box Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.212 | (34) | Kaman Corp | Goldman Sachs | 10 |
| (666) | Jack in the Box Inc | Goldman Sachs | 7.299 | (74) | Karuna Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 632 |
| (239) | Jackson Financial Inc 'A' | Goldman Sachs | 215 | (130) | Karuna Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.110 |
| (41) | Jacobs Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 149 | (57) | Karuna Therapeutics Inc | Morgan Stanley | 215 |
| (41) | Jacobs Solutions Inc | Goldman Sachs | 149 | 823 | Karyopharm Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (189) |
| (42) | Jacobs Solutions Inc | Morgan Stanley | 281 | 316 | Karyopharm Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (73) |
| 849 | Jamf Holding Corp | Goldman Sachs | 611 | (1.086) | KB Home | Goldman Sachs | 1.951 |
| (623) | Janus Henderson Group Plc | Bank of America Merrill Lynch | (61) | 885 | Kearny Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | 124 |
| (118) | Janus Henderson Group Plc | Goldman Sachs | (4) | 198 | Kearny Financial Corp | Goldman Sachs | 28 |
| (99) | Janus Henderson Group Plc | Morgan Stanley | 63 | (205) | Kemper Corp | Bank of America Merrill Lynch | 236 |
| 1.616 | Janus International Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (679) | 849 | Kennametal Inc | Bank of America Merrill Lynch | (807) |
| 2.685 | Janus International Group Inc | Goldman Sachs | (1.128) | 760 | Kennametal Inc | Goldman Sachs | (722) |
| (80) | Jazz Pharmaceuticals Plc | Bank of America Merrill Lynch | 677 | (320) | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (314) |
| (118) | Jazz Pharmaceuticals Plc | Goldman Sachs | 998 | (2.030) | Kennedy-Wilson Holdings Inc | Goldman Sachs | (1.989) |
| (263) | Jazz Pharmaceuticals Plc | Morgan Stanley | 1.765 | (48) | Keros Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (63) |
| (2.382) | JBG SMITH Properties (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.075 | (162) | Keros Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (214) |
| (375) | JBG SMITH Properties (REIT) | Goldman Sachs | 195 | 255 | KeyCorp | Bank of America Merrill Lynch | 20 |
| 81 | Jefferies Financial Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4 | 203 | KeyCorp | Goldman Sachs | (109) |
| 927 | Jefferies Financial Group Inc | Morgan Stanley | (510) | 444 | KeyCorp | Morgan Stanley | (271) |
| 442 | JELD-WEN Holding Inc | Bank of America Merrill Lynch | (460) | 59 | Keysight Technologies Inc | Goldman Sachs | 827 |
| 566 | JELD-WEN Holding Inc | Goldman Sachs | (598) | 492 | Keysight Technologies Inc | Morgan Stanley | 2.012 |
| 6.272 | JetBlue Airways Corp | Bank of America Merrill Lynch | (721) | 140 | Kforce Inc | Goldman Sachs | 148 |
| 7.828 | JetBlue Airways Corp | Goldman Sachs | (900) | (302) | Kimball Electronics Inc | Goldman Sachs | (846) |
| (1.183) | JFrog Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (1.325) | (804) | Kinder Morgan Inc | Bank of America Merrill Lynch | 474 |
| (25) | JFrog Ltd | Goldman Sachs | (28) | (354) | Kinder Morgan Inc | Goldman Sachs | 209 |
| (3.158) | Joby Aviation Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.400) | (3.211) | Kinder Morgan Inc | Morgan Stanley | 1.349 |
| (9.583) | Joby Aviation Inc | Goldman Sachs | (7.150) | (1.654) | Kinetik Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (864) |
| 134 | John B Sanfilippo & Son Inc | Bank of America Merrill Lynch | 427 | (112) | Kinetik Holdings Inc | Goldman Sachs | (71) |
| 36 | John B Sanfilippo & Son Inc | Goldman Sachs | 63 | (114) | Kinsale Capital Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.285 |
| 176 | John Bean Technologies Corp | Bank of America Merrill Lynch | 715 | (29) | Kinsale Capital Group Inc | Goldman Sachs | 581 |
| 124 | John Bean Technologies Corp | Goldman Sachs | 503 | (300) | Kinsale Capital Group Inc | Morgan Stanley | 3.255 |
| (1.714) | John Wiley & Sons Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (857) | (27) | Kirby Corp | Morgan Stanley | 45 |
| (2.343) | John Wiley & Sons Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.171) | (4.273) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 6.495 |
| 20 | Johnson & Johnson | Bank of America Merrill Lynch | (6) | (3.863) | Kite Realty Group Trust (REIT) | Morgan Stanley | 4.636 |
| 1.208 | Johnson Controls International Plc | Morgan Stanley | (2.863) | (2.631) | KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.052) |
| 28 | Johnson Outdoors Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (66) | 959 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.251) |
| 34 | Johnson Outdoors Inc 'A' | Goldman Sachs | (80) | 351 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Goldman Sachs | (463) |
| 68 | Jones Lang LaSalle Inc | Morgan Stanley | (326) | 705 | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Morgan Stanley | 122 |
| (273) | JPMorgan Chase & Co | Goldman Sachs | (11) | 1.751 | Knowles Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.942 |
| (540) | JPMorgan Chase & Co | Morgan Stanley | 1.490 | 1.012 | Knowles Corp | Goldman Sachs | 1.700 |
| (545) | Juniper Networks Inc | Bank of America Merrill Lynch | (134) | 93 | Kodiak Sciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | 36 |
| (623) | Juniper Networks Inc | Morgan Stanley | (420) | 373 | Kodiak Sciences Inc | Goldman Sachs | 145 |
| 212 | Kadant Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.785) | 1.650 | Kohl's Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.887) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|----------------------------------|---|---|--|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 648 | Kohl's Corp | Goldman Sachs | (1.134) | 556 | Lattice Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (357) |
| 725 | Kontoor Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | (696) | 390 | Lattice Semiconductor Corp | Morgan Stanley | (425) |
| 258 | Kontoor Brands Inc | Goldman Sachs | (248) | 3.592 | Laureate Education Inc | Bank of America Merrill Lynch | 593 |
| (120) | Koppers Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 278 | 2.290 | Laureate Education Inc | Goldman Sachs | 378 |
| (124) | Koppers Holdings Inc | Goldman Sachs | 288 | 1.019 | La-Z-Boy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.325) |
| 922 | Korn Ferry | Bank of America Merrill Lynch | (138) | 923 | La-Z-Boy Inc | Goldman Sachs | (1.200) |
| 656 | Korn Ferry | Goldman Sachs | (98) | (145) | LCI Industries | Bank of America Merrill Lynch | 390 |
| 623 | Kornit Digital Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (442) | (251) | LCI Industries | Goldman Sachs | 712 |
| 1.036 | Kornit Digital Ltd | Goldman Sachs | (736) | 369 | Lear Corp | Morgan Stanley | (1.048) |
| (1.377) | Kosmos Energy Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 145 | (763) | Leggett & Platt Inc | Goldman Sachs | 1.503 |
| (4.138) | Kosmos Energy Ltd | Goldman Sachs | 434 | (1.144) | Leggett & Platt Inc | Morgan Stanley | 2.311 |
| (140) | Kraft Heinz Co | Goldman Sachs | 125 | 216 | LeMaitre Vascular Inc | Bank of America Merrill Lynch | (449) |
| 199 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (80) | 747 | LeMaitre Vascular Inc | Goldman Sachs | (1.554) |
| 584 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Goldman Sachs | (234) | (2.238) | Lemonade Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.208) |
| (3.548) | Krispy Kreme Inc | Bank of America Merrill Lynch | 674 | (85) | LendingClub Corp | Goldman Sachs | (1) |
| (281) | Kronos Worldwide Inc | Bank of America Merrill Lynch | (112) | 497 | LendingTree Inc | Bank of America Merrill Lynch | 249 |
| (541) | Kronos Worldwide Inc | Goldman Sachs | (216) | 1.276 | LendingTree Inc | Goldman Sachs | 638 |
| (147) | Kulicke & Soffa Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (697) | (720) | Lennar Corp 'A' | Goldman Sachs | 4.435 |
| (171) | Kulicke & Soffa Industries Inc | Goldman Sachs | (811) | (345) | Lennar Corp 'A' | Morgan Stanley | 1.159 |
| 1.097 | Kura Oncology Inc | Bank of America Merrill Lynch | 812 | 265 | Lennox International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.136) |
| 906 | Kura Oncology Inc | Goldman Sachs | 670 | 63 | Lennox International Inc | Goldman Sachs | (508) |
| (172) | Kura Sushi USA Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.921) | 337 | Lennox International Inc | Morgan Stanley | (839) |
| (251) | Kura Sushi USA Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.812) | (1.583) | Leonardo DRS Inc | Bank of America Merrill Lynch | 578 |
| 45 | Kymera Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (16) | (1.623) | Leonardo DRS Inc | Goldman Sachs | 592 |
| 50 | Kymera Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (28) | (684) | Leslie's Inc | Bank of America Merrill Lynch | 899 |
| 336 | Kyndryl Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (87) | (2.008) | Leslie's Inc | Goldman Sachs | 2.641 |
| 342 | Kyndryl Holdings Inc | Goldman Sachs | (105) | (1.879) | Levi Strauss & Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 808 |
| 291 | Laboratory Corp of America Holdings | Morgan Stanley | (2.628) | (1.114) | Levi Strauss & Co 'A' | Goldman Sachs | 479 |
| 365 | Ladder Capital Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 106 | (782) | Levi Strauss & Co 'A' | Morgan Stanley | (63) |
| 1.099 | Ladder Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | 319 | (2.721) | Lexicon Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 109 |
| (299) | Lakeland Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (230) | (195) | LGI Homes Inc | Bank of America Merrill Lynch | 648 |
| (550) | Lakeland Bancorp Inc | Goldman Sachs | (381) | (328) | LGI Homes Inc | Goldman Sachs | 1.091 |
| (17) | Lakeland Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (130) | 549 | Liberty Broadband Corp 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (1.735) |
| 116 | Lam Research Corp | Bank of America Merrill Lynch | 8.511 | 329 | Liberty Broadband Corp 'C' | Goldman Sachs | (1.040) |
| 80 | Lam Research Corp | Goldman Sachs | 5.911 | 416 | Liberty Broadband Corp 'C' | Morgan Stanley | (1.161) |
| 27 | Lam Research Corp | Morgan Stanley | 1.109 | (1.372) | Liberty Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 329 |
| 139 | Landstar System Inc | Bank of America Merrill Lynch | (368) | (1.696) | Liberty Energy Inc | Goldman Sachs | 429 |
| 12 | Landstar System Inc | Goldman Sachs | (32) | 253 | Liberty Global Plc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (301) |
| 181 | Landstar System Inc | Morgan Stanley | (20) | 2.833 | Liberty Global Plc 'A' | Goldman Sachs | (3.371) |
| (375) | Lantheus Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.826 | 1.761 | Liberty Global Plc 'A' | Morgan Stanley | (1.197) |
| (152) | Lantheus Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.956 | 2.439 | Liberty Global Plc 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (2.805) |
| (697) | Lantheus Holdings Inc | Morgan Stanley | 8.350 | 3.213 | Liberty Global Plc 'C' | Goldman Sachs | (3.695) |
| (303) | Latham Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (27) | 1.321 | Liberty Global Plc 'C' | Morgan Stanley | (885) |
| (245) | Latham Group Inc | Goldman Sachs | (22) | 594 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (511) |
| 389 | Lattice Semiconductor Corp | Bank of America Merrill Lynch | 795 | 362 | Liberty Latin America Ltd 'A' | Goldman Sachs | (311) |
| | | | | 178 | Liberty Latin America Ltd 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (159) |
| | | | | 444 | Liberty Latin America Ltd 'C' | Goldman Sachs | (397) |
| | | | | 356 | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (619) |
| | | | | 286 | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A' | Goldman Sachs | (498) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (566) | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 968 | 217 | Lowe's Cos Inc | Goldman Sachs | 143 |
| (461) | Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C' | Goldman Sachs | 788 | 371 | Lowe's Cos Inc | Morgan Stanley | (349) |
| (397) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Bank of America Merrill Lynch | 1.846 | 689 | LSB Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 289 |
| (335) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Goldman Sachs | 1.558 | 1.331 | LSB Industries Inc | Goldman Sachs | 559 |
| (399) | Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C' | Morgan Stanley | 794 | (519) | LTC Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 996 |
| 243 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (80) | (612) | LTC Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.027 |
| 80 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Goldman Sachs | (26) | (19) | Lululemon Athletica Inc | Bank of America Merrill Lynch | 207 |
| 367 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' | Morgan Stanley | (18) | (36) | Lululemon Athletica Inc | Goldman Sachs | 362 |
| 1 | Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | — | (31) | Lululemon Athletica Inc | Morgan Stanley | 274 |
| (1.408) | Life Time Group Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.267 | (4.420) | Luminar Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.066) |
| (805) | Life Time Group Holdings Inc | Goldman Sachs | 725 | (1.345) | Luminar Technologies Inc | Goldman Sachs | (1.237) |
| 130 | Ligand Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (980) | 318 | Luxfer Holdings Plc | Bank of America Merrill Lynch | 19 |
| 234 | Ligand Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (1.764) | 422 | Luxfer Holdings Plc | Goldman Sachs | 25 |
| (2.256) | Lightwave Logic Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.663) | 2.410 | LXP Industrial Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 578 |
| (1.363) | Lightwave Logic Inc | Goldman Sachs | (2.718) | 3.585 | LXP Industrial Trust (REIT) | Goldman Sachs | 860 |
| 192 | Lincoln National Corp | Goldman Sachs | 273 | 195 | Lyft Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 90 |
| 346 | Lincoln National Corp | Morgan Stanley | (298) | 747 | Lyft Inc 'A' | Morgan Stanley | 672 |
| (221) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 188 | (63) | M&T Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | (78) |
| (256) | Lindblad Expeditions Holdings Inc | Goldman Sachs | 179 | (448) | M/I Homes Inc | Bank of America Merrill Lynch | (728) |
| (87) | Linde Plc | Bank of America Merrill Lynch | 507 | (273) | M/I Homes Inc | Goldman Sachs | (424) |
| (94) | Linde Plc | Goldman Sachs | 1.319 | 1.078 | Macerich Co (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (86) |
| (149) | Linde Plc | Morgan Stanley | 1.354 | 979 | Macerich Co (REIT) | Goldman Sachs | (78) |
| 259 | Lindsay Corp | Bank of America Merrill Lynch | (414) | 742 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley | 111 |
| 169 | Lindsay Corp | Goldman Sachs | (270) | 3.476 | Macy's Inc | Morgan Stanley | (4.136) |
| 478 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (10) | (271) | Madison Square Garden Entertainment Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.390) |
| 819 | Lions Gate Entertainment Corp 'A' | Goldman Sachs | (16) | (138) | Madison Square Garden Entertainment Corp | Goldman Sachs | (799) |
| (46) | Lithia Motors Inc | Morgan Stanley | (390) | (50) | Madison Square Garden Sports Corp | Bank of America Merrill Lynch | 685 |
| (9) | Littelfuse Inc | Goldman Sachs | 4 | (369) | Madison Square Garden Sports Corp | Goldman Sachs | 5.055 |
| 806 | LivaNova Plc | Bank of America Merrill Lynch | (2.789) | (245) | Madison Square Garden Sports Corp | Morgan Stanley | 1.504 |
| 849 | LivaNova Plc | Goldman Sachs | (2.938) | 1.002 | Magnachip Semiconductor Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.443 |
| (308) | Live Nation Entertainment Inc | Morgan Stanley | 1.398 | 693 | Magnachip Semiconductor Corp | Goldman Sachs | 998 |
| 283 | Live Oak Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 125 | (114) | Magnite Inc | Goldman Sachs | 29 |
| 215 | Live Oak Bancshares Inc | Goldman Sachs | 95 | 288 | Malibu Boats Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (717) |
| 1.620 | LivePerson Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.037) | 749 | Malibu Boats Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.865) |
| 1.779 | LivePerson Inc | Goldman Sachs | (1.139) | (146) | Manchester United Plc 'A' | Morgan Stanley | 158 |
| 730 | LiveRamp Holdings Inc | Goldman Sachs | (467) | 646 | Manhattan Associates Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.156 |
| 59 | LKQ Corp | Morgan Stanley | (130) | 861 | Manhattan Associates Inc | Goldman Sachs | 7.658 |
| (397) | Loews Corp | Bank of America Merrill Lynch | 695 | 793 | Manhattan Associates Inc | Morgan Stanley | 2.591 |
| (161) | Loews Corp | Goldman Sachs | 282 | 247 | Manitowoc Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | (267) |
| (1.671) | Loews Corp | Morgan Stanley | 3.426 | (1.299) | Manitowoc Co Inc | Goldman Sachs | (355) |
| 1.451 | Louisiana-Pacific Corp | Bank of America Merrill Lynch | (7.008) | (2.202) | MannKind Corp | Bank of America Merrill Lynch | (10) |
| 265 | Louisiana-Pacific Corp | Morgan Stanley | (636) | (43) | ManpowerGroup Inc | Goldman Sachs | 103 |
| 147 | Lovesac Co | Goldman Sachs | (513) | (28) | ManpowerGroup Inc | Morgan Stanley | 116 |
| 26 | Lowe's Cos Inc | Bank of America Merrill Lynch | 17 | 1.332 | Marathon Oil Corp | Bank of America Merrill Lynch | (649) |
| | | | | 1.852 | Marathon Oil Corp | Goldman Sachs | (611) |
| | | | | 3.136 | Marathon Oil Corp | Morgan Stanley | (3.418) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 513 | Marathon Petroleum Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.729) | 23 | Maxeon Solar Technologies Ltd ^{††} | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 153 | Marathon Petroleum Corp | Goldman Sachs | (811) | 110 | Maxeon Solar Technologies Ltd | Goldman Sachs | 65 |
| 236 | Marathon Petroleum Corp | Morgan Stanley | (1.224) | (343) | Maximus Inc | Bank of America Merrill Lynch | (240) |
| (794) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.386 | (284) | Maximus Inc | Goldman Sachs | (199) |
| (1.052) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | 3.161 | (3.757) | Maximus Inc | Morgan Stanley | 5.523 |
| (3.375) | Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.417 | 653 | MaxLinear Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.833 |
| (213) | Marcus & Millichap Inc | Bank of America Merrill Lynch | (183) | 1.207 | MaxLinear Inc | Goldman Sachs | 5.326 |
| (231) | Marcus & Millichap Inc | Goldman Sachs | (199) | (318) | MBIA Inc | Bank of America Merrill Lynch | (48) |
| 410 | Marcus Corp | Bank of America Merrill Lynch | (418) | (1.086) | MBIA Inc | Goldman Sachs | (53) |
| 2.083 | Marcus Corp | Goldman Sachs | (2.125) | 429 | McCormick & Co Inc | Morgan Stanley | (1.244) |
| 401 | MarineMax Inc | Bank of America Merrill Lynch | 140 | 31 | McDonald's Corp | Morgan Stanley | (49) |
| 587 | MarineMax Inc | Goldman Sachs | 205 | (31) | McGrath RentCorp | Bank of America Merrill Lynch | 45 |
| (14) | Markel Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 586 | (159) | McGrath RentCorp | Goldman Sachs | 176 |
| (23) | Markel Group Inc | Goldman Sachs | 962 | (619) | MDC Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 150 |
| (37) | Markel Group Inc | Morgan Stanley | 1.114 | (341) | MDC Holdings Inc | Goldman Sachs | 338 |
| (75) | MarketAxess Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.317 | (576) | MDU Resources Group Inc | Morgan Stanley | 570 |
| (46) | MarketAxess Holdings Inc | Goldman Sachs | 808 | (187) | MediaAlpha Inc 'A' | Goldman Sachs | 16 |
| (116) | MarketAxess Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.228 | 434 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 278 |
| 244 | Marqeta Inc 'A' | Goldman Sachs | (2) | 1.279 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 819 |
| (256) | Marriott International Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 2.196 | 2.506 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | 526 |
| (33) | Marriott International Inc 'A' | Goldman Sachs | 283 | 110 | Medifast Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.228) |
| (118) | Marriott International Inc 'A' | Morgan Stanley | 916 | 68 | Medifast Inc | Goldman Sachs | (759) |
| 240 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Bank of America Merrill Lynch | (295) | (61) | Medpace Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 318 |
| 114 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Goldman Sachs | (140) | (172) | Medpace Holdings Inc | Goldman Sachs | 896 |
| 137 | Marriott Vacations Worldwide Corp | Morgan Stanley | (344) | (179) | Medpace Holdings Inc | Morgan Stanley | 696 |
| 404 | Marten Transport Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 263 | 18 | MercadoLibre Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.007) |
| 10 | Martin Marietta Materials Inc | Morgan Stanley | (46) | 3 | MercadoLibre Inc | Goldman Sachs | (177) |
| 715 | Masco Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.088) | 3 | MercadoLibre Inc | Morgan Stanley | (296) |
| 482 | Masco Corp | Goldman Sachs | (1.407) | 55 | Mercantile Bank Corp | Bank of America Merrill Lynch | 84 |
| 993 | Masco Corp | Morgan Stanley | (2.582) | 61 | Mercantile Bank Corp | Goldman Sachs | 93 |
| (74) | Masonite International Corp | Bank of America Merrill Lynch | 103 | (1.537) | Mercer International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 83 |
| (37) | Masonite International Corp | Goldman Sachs | 12 | (799) | Mercer International Inc | Goldman Sachs | 46 |
| (1.847) | Masterbrand Inc | Bank of America Merrill Lynch | 597 | 368 | Merchants Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | 107 |
| (2.761) | Masterbrand Inc | Goldman Sachs | 1.040 | 105 | Merchants Bancorp | Goldman Sachs | 30 |
| 24 | Mastercard Inc 'A' | Goldman Sachs | (563) | 1.298 | Mercury General Corp | Bank of America Merrill Lynch | 286 |
| 7 | Mastercard Inc 'A' | Morgan Stanley | (172) | 976 | Mercury General Corp | Goldman Sachs | 215 |
| 465 | Match Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 911 | (1.060) | Mercury Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.802 |
| 1.164 | Match Group Inc | Goldman Sachs | 2.281 | (985) | Mercury Systems Inc | Goldman Sachs | 1.675 |
| 1.305 | Match Group Inc | Morgan Stanley | 548 | (631) | MeridianLink Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.304) |
| (106) | Materion Corp | Bank of America Merrill Lynch | 88 | (715) | MeridianLink Inc | Goldman Sachs | (1.616) |
| (179) | Materion Corp | Goldman Sachs | 149 | 28 | Merit Medical Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (79) |
| (184) | Mativ Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 379 | (454) | Meritage Homes Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.269 |
| (632) | Mativ Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.302 | (329) | Meritage Homes Corp | Goldman Sachs | 2.278 |
| 380 | Matson Inc | Goldman Sachs | 1.144 | (183) | Meritage Homes Corp | Morgan Stanley | 576 |
| (3.435) | Matterport Inc | Goldman Sachs | (137) | 71 | Merus NV | Bank of America Merrill Lynch | (10) |
| (866) | Matthews International Corp 'A' | Goldman Sachs | (1.264) | (25) | Mesa Laboratories Inc | Bank of America Merrill Lynch | 675 |
| (1.310) | MaxCyte Inc | Bank of America Merrill Lynch | (314) | (109) | Mesa Laboratories Inc | Goldman Sachs | 2.943 |
| (434) | MaxCyte Inc | Goldman Sachs | (30) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 101 | Meta Platforms Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.359 | 199 | Model N Inc | Bank of America | |
| (125) | Methode Electronics Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 519 |
| | | Merrill Lynch | (309) | 1.078 | Model N Inc | Goldman Sachs | 2.814 |
| (366) | Methode Electronics Inc | Goldman Sachs | (904) | (262) | Moderna Inc | Goldman Sachs | 492 |
| 2.306 | MetLife Inc | Bank of America | | (123) | Moderna Inc | Morgan Stanley | (199) |
| | | Merrill Lynch | (1.722) | 137 | Modine Manufacturing Co | Bank of America | |
| 1.892 | MetLife Inc | Goldman Sachs | (813) | | | Merrill Lynch | 507 |
| 1.294 | MetLife Inc | Morgan Stanley | (2.616) | 146 | Modine Manufacturing Co | Goldman Sachs | 288 |
| (14) | Metropolitan Bank Holding Corp | Bank of America | | 119 | ModivCare Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (92) | | | Merrill Lynch | (1.107) |
| (73) | Metropolitan Bank Holding Corp | Goldman Sachs | (136) | 139 | ModivCare Inc | Goldman Sachs | (1.471) |
| 2 | Mettler-Toledo International Inc | Bank of America | | (852) | Moelis & Co 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (168) | | | Merrill Lynch | (2.812) |
| 40 | Mettler-Toledo International Inc | Morgan Stanley | (3.872) | (910) | Moelis & Co 'A' | Goldman Sachs | (3.003) |
| | | Bank of America | | 532 | Mohawk Industries Inc | Goldman Sachs | (1.362) |
| 2.049 | MFA Financial Inc (REIT) | Merrill Lynch | 881 | 59 | Mohawk Industries Inc | Morgan Stanley | (169) |
| | | Goldman Sachs | 993 | 7 | Molina Healthcare Inc | Goldman Sachs | (93) |
| 2.310 | MFA Financial Inc (REIT) | Bank of America | | 1.220 | Molson Coors Beverage Co 'B' | Morgan Stanley | (1.391) |
| 84 | MGE Energy Inc | Merrill Lynch | (470) | (2.320) | Momentive Global Inc | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | (683) | | | Merrill Lynch | (146) |
| 2.298 | MGIC Investment Corp | Goldman Sachs | 1.057 | (628) | Momentive Global Inc | Goldman Sachs | (27) |
| 4 | MGIC Investment Corp | Morgan Stanley | 1 | 461 | Monarch Casino & Resort Inc | Bank of America | |
| 2.633 | MGM Resorts International | Morgan Stanley | (7.977) | | | Merrill Lynch | (742) |
| 329 | MGP Ingredients Inc | Bank of America | | 425 | Monarch Casino & Resort Inc | Goldman Sachs | (684) |
| | | Merrill Lynch | (1.928) | (731) | Mondelez International Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.972 |
| 474 | MGP Ingredients Inc | Goldman Sachs | (2.778) | (99) | MongoDB Inc | Bank of America | |
| 2.462 | Micron Technology Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.081) |
| | | Merrill Lynch | 9.897 | (276) | MongoDB Inc | Goldman Sachs | (5.802) |
| 481 | Micron Technology Inc | Goldman Sachs | 1.934 | (236) | MongoDB Inc | Morgan Stanley | (3.280) |
| 856 | Micron Technology Inc | Morgan Stanley | 2.080 | (148) | Monro Inc | Bank of America | |
| 1.047 | Microsoft Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 975 |
| | | Merrill Lynch | 23.888 | (194) | Monro Inc | Goldman Sachs | 1.078 |
| 180 | Microsoft Corp | Goldman Sachs | 4.561 | (251) | Montauk Renewables Inc | Bank of America | |
| 1.766 | Microsoft Corp | Morgan Stanley | 21.907 | | | Merrill Lynch | (9) |
| (10) | MicroStrategy Inc 'A' | Morgan Stanley | (77) | (531) | Montrose Environmental Group Inc | Bank of America | |
| (90) | Middlesex Water Co | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 563 |
| | | Merrill Lynch | (406) | (599) | Montrose Environmental Group Inc | Goldman Sachs | 659 |
| (98) | Middlesex Water Co | Goldman Sachs | (554) | (22) | Moody's Corp | Bank of America | |
| 383 | Midland States Bancorp Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 22 |
| | | Merrill Lynch | 383 | (34) | Moody's Corp | Goldman Sachs | (91) |
| 845 | Midland States Bancorp Inc | Goldman Sachs | 845 | 113 | Moog Inc 'A' | Bank of America | |
| 327 | MidWestOne Financial Group Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (285) |
| | | Merrill Lynch | 219 | (127) | Morgan Stanley | Goldman Sachs | 50 |
| 348 | MidWestOne Financial Group Inc | Goldman Sachs | 233 | 207 | Morningstar Inc | Goldman Sachs | 2.768 |
| 290 | MillerKnoll Inc | Goldman Sachs | (217) | (453) | Morphic Holding Inc | Bank of America | |
| (32) | Minerals Technologies Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 421 |
| | | Merrill Lynch | 116 | (106) | Morphic Holding Inc | Goldman Sachs | 99 |
| (440) | Minerals Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.602 | (41) | Mosaic Co | Bank of America | |
| (222) | Mirati Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 2.384 | | | Merrill Lynch | 167 |
| (3.939) | Mirion Technologies Inc | Bank of America | | (1.102) | Mosaic Co | Goldman Sachs | 4.485 |
| | | Merrill Lynch | (748) | (224) | Mosaic Co | Morgan Stanley | 773 |
| (707) | Mirum Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | (131) | Motorola Solutions Inc | Goldman Sachs | 939 |
| | | Merrill Lynch | (156) | (328) | Motorola Solutions Inc | Morgan Stanley | 2.968 |
| (200) | Mirum Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (44) | 171 | Movado Group Inc | Bank of America | |
| (1.009) | Mission Produce Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 91 |
| | | Merrill Lynch | (307) | 524 | Movado Group Inc | Goldman Sachs | 278 |
| (866) | Mission Produce Inc | Goldman Sachs | (286) | 169 | MP Materials Corp | Morgan Stanley | (176) |
| 1.957 | Mister Car Wash Inc | Bank of America | | 661 | Mr Cooper Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.272) | | | Merrill Lynch | 833 |
| 1.081 | Mister Car Wash Inc | Goldman Sachs | (703) | 455 | Mr Cooper Group Inc | Goldman Sachs | 573 |
| (153) | Mitek Systems Inc | Bank of America | | 163 | MRC Global Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (81) | | | Merrill Lynch | (18) |
| (228) | Mitek Systems Inc | Goldman Sachs | (37) | 2.882 | MRC Global Inc | Goldman Sachs | (317) |
| (815) | MKS Instruments Inc | Bank of America | | 122 | MSA Safety Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (10.399) | | | Merrill Lynch | (268) |
| (534) | MKS Instruments Inc | Goldman Sachs | (6.814) | 178 | MSA Safety Inc | Goldman Sachs | (392) |
| (831) | MKS Instruments Inc | Morgan Stanley | (6.540) | (111) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Goldman Sachs | (40) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-------------------------------|---|---|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (27) | MSC Industrial Direct Co Inc 'A' | Morgan Stanley | 79 | (832) | Navitas Semiconductor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.402) |
| 42 | MSCI Inc | Goldman Sachs | 255 | (1.190) | Navitas Semiconductor Corp | Goldman Sachs | (2.005) |
| 51 | MSCI Inc | Morgan Stanley | (142) | (234) | NBT Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (159) |
| (1.953) | Mueller Water Products Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (410) | (543) | NBT Bancorp Inc | Goldman Sachs | (369) |
| (3.868) | Mueller Water Products Inc 'A' | Goldman Sachs | (812) | (1.204) | nCino Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.798) |
| 150 | Myers Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (15) | (1.594) | nCino Inc | Goldman Sachs | (6.679) |
| 188 | Myers Industries Inc | Goldman Sachs | (19) | (213) | NCR Corp | Bank of America Merrill Lynch | 11 |
| 135 | MYR Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (633) | (820) | NCR Corp | Goldman Sachs | 41 |
| 305 | MYR Group Inc | Goldman Sachs | (1.430) | (582) | NCR Corp | Morgan Stanley | 338 |
| 239 | Myriad Genetics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 891 | (368) | Nelnet Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 578 |
| 342 | Myriad Genetics Inc | Goldman Sachs | 1.276 | (532) | Nelnet Inc 'A' | Goldman Sachs | 835 |
| (602) | N-able Inc | Bank of America Merrill Lynch | (277) | 380 | NeoGenomics Inc | Goldman Sachs | (840) |
| (976) | N-able Inc | Goldman Sachs | (449) | 416 | NetApp Inc | Goldman Sachs | 1.273 |
| 154 | Nabors Industries Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (748) | 78 | NetApp Inc | Morgan Stanley | 53 |
| 245 | Nabors Industries Ltd | Goldman Sachs | (1.191) | (30) | Netflix Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.749) |
| 230 | NanoString Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (89) | (252) | Netflix Inc | Morgan Stanley | (7.860) |
| 43 | NanoString Technologies Inc | Goldman Sachs | (105) | 247 | NETGEAR Inc | Bank of America Merrill Lynch | 16 |
| 548 | Napco Security Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.578 | 685 | NETGEAR Inc | Goldman Sachs | (38) |
| 614 | Napco Security Technologies Inc | Goldman Sachs | 1.768 | (477) | NetScout Systems Inc | Bank of America Merrill Lynch | (251) |
| (109) | Natera Inc | Bank of America Merrill Lynch | 477 | (407) | NetScout Systems Inc | Goldman Sachs | (440) |
| (199) | Natera Inc | Goldman Sachs | 871 | (720) | NETSTREIT Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 311 |
| (614) | Natera Inc | Morgan Stanley | 3.245 | (1.853) | NETSTREIT Corp (REIT) | Goldman Sachs | 854 |
| (142) | National Bank Holdings Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (160) | 87 | Neurocrine Biosciences Inc | Bank of America Merrill Lynch | (643) |
| (159) | National Bank Holdings Corp 'A' | Goldman Sachs | (180) | 114 | Neurocrine Biosciences Inc | Goldman Sachs | (650) |
| 492 | National Beverage Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.220) | 449 | Neurocrine Biosciences Inc | Morgan Stanley | (1.230) |
| 319 | National Beverage Corp | Goldman Sachs | (791) | 644 | Nevro Corp | Bank of America Merrill Lynch | (960) |
| (28) | National Health Investors Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (7) | 731 | Nevro Corp | Goldman Sachs | (1.089) |
| (388) | National Health Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | 516 | (283) | New Fortress Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 942 |
| 583 | National HealthCare Corp | Bank of America Merrill Lynch | 663 | (70) | New Fortress Energy Inc | Goldman Sachs | 233 |
| 219 | National HealthCare Corp | Goldman Sachs | 230 | (165) | New Jersey Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | 175 |
| (206) | National Presto Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (459) | (1.005) | New Jersey Resources Corp | Goldman Sachs | 1.065 |
| (318) | National Presto Industries Inc | Goldman Sachs | (709) | (478) | New Jersey Resources Corp | Morgan Stanley | 378 |
| 31 | National Research Corp | Bank of America Merrill Lynch | 60 | (291) | New Relic Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.420 |
| 15 | National Research Corp | Goldman Sachs | 29 | (324) | New Relic Inc | Goldman Sachs | 1.581 |
| (245) | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 326 | (313) | New Relic Inc | Morgan Stanley | 3.834 |
| (650) | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Goldman Sachs | 865 | (220) | New York Community Bancorp Inc | Morgan Stanley | 110 |
| (1.638) | National Storage Affiliates Trust (REIT) | Morgan Stanley | 1.310 | 446 | New York Mortgage Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (4) |
| 1.129 | National Vision Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.603 | 343 | New York Mortgage Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3) |
| 111 | National Vision Holdings Inc | Goldman Sachs | 158 | (1.413) | New York Times Co 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.313 |
| (13) | National Western Life Group Inc 'A' | Goldman Sachs | (383) | (324) | New York Times Co 'A' | Goldman Sachs | 300 |
| 813 | Navient Corp | Bank of America Merrill Lynch | 146 | (555) | New York Times Co 'A' | Morgan Stanley | 502 |
| 769 | Navient Corp | Goldman Sachs | 138 | (5.232) | Newell Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 4.238 |
| | | | | (4.028) | Newell Brands Inc | Goldman Sachs | 3.263 |
| | | | | (2.594) | Newell Brands Inc | Morgan Stanley | 1.193 |
| | | | | 1.420 | Newmark Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 263 |
| | | | | 819 | Newmark Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 152 |
| | | | | (82) | NewMarket Corp | Goldman Sachs | (95) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 663 | Newmont Corp | Bank of America Merrill Lynch | (2.421) | (1.837) | Northwest Bancshares Inc | Goldman Sachs | 23 |
| 531 | Newmont Corp | Goldman Sachs | (3.208) | 335 | Northwest Natural Holding Co | Bank of America Merrill Lynch | (717) |
| 3.270 | Newmont Corp | Morgan Stanley | (8.883) | 243 | Northwest Natural Holding Co | Goldman Sachs | (438) |
| (5.838) | News Corp 'A' | Goldman Sachs | 759 | (591) | NorthWestern Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.265 |
| (3.173) | News Corp 'A' | Morgan Stanley | (301) | (1.369) | NorthWestern Corp | Goldman Sachs | 2.930 |
| 833 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (275) | 100 | NOV Inc | Bank of America Merrill Lynch | (83) |
| 1.323 | NexPoint Residential Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (437) | 129 | NOV Inc | Goldman Sachs | (107) |
| 74 | Nexstar Media Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (792) | 389 | NOV Inc | Morgan Stanley | (397) |
| 104 | Nexstar Media Group Inc | Goldman Sachs | (1.113) | 221 | Nova Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 3.054 |
| 74 | Nexstar Media Group Inc | Morgan Stanley | (731) | 372 | Nova Ltd | Goldman Sachs | 5.141 |
| (865) | NextDecade Corp | Bank of America Merrill Lynch | 575 | 167 | Nova Ltd | Morgan Stanley | 1.652 |
| (976) | NextDecade Corp | Goldman Sachs | 742 | (1.147) | Novanta Inc | Morgan Stanley | 1.067 |
| (6.414) | Nextdoor Holdings Inc | Goldman Sachs | (706) | 8 | Novocure Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (36) |
| (54) | NextEra Energy Inc | Goldman Sachs | 203 | 12 | Novocure Ltd | Goldman Sachs | (54) |
| 1.221 | NextEra Energy Partners LP | Bank of America Merrill Lynch | (2.979) | 223 | Novocure Ltd | Morgan Stanley | (1.684) |
| 482 | NextEra Energy Partners LP | Goldman Sachs | (1.176) | 1.659 | NOW Inc | Bank of America Merrill Lynch | (415) |
| 2.025 | NextGen Healthcare Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.536) | 1.003 | NOW Inc | Goldman Sachs | (251) |
| 1.857 | NextGen Healthcare Inc | Goldman Sachs | (2.236) | 192 | NRG Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (73) |
| (1.057) | NexTier Oilfield Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | 105 | 193 | NRG Energy Inc | Goldman Sachs | (73) |
| (7.746) | NexTier Oilfield Solutions Inc | Goldman Sachs | (165) | 184 | NRG Energy Inc | Morgan Stanley | (116) |
| (21) | NEXTracker Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 32 | (454) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.712 |
| (381) | NEXTracker Inc 'A' | Goldman Sachs | 575 | (428) | Nu Skin Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.614 |
| (1.237) | NEXTracker Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.447 | 114 | Nucor Corp | Bank of America Merrill Lynch | (510) |
| (82) | Nicolet Bankshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (664) | 88 | Nucor Corp | Goldman Sachs | (485) |
| (82) | Nicolet Bankshares Inc | Goldman Sachs | (765) | 27 | Nucor Corp | Morgan Stanley | (163) |
| (1.106) | nLight Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.610) | 229 | Nurix Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (266) |
| (1.683) | nLight Inc | Goldman Sachs | (2.575) | 328 | Nurix Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (380) |
| (216) | NMI Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (354) | (239) | Nutanix Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (820) |
| (272) | NMI Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (446) | (335) | Nutanix Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.149) |
| (311) | NNN Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 594 | (533) | Nuvalent Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (85) |
| (121) | NNN Inc (REIT) | Goldman Sachs | 231 | (290) | Nuvalent Inc 'A' | Goldman Sachs | (46) |
| (1.998) | Noble Corp Plc | Bank of America Merrill Lynch | (1.678) | 161 | NV5 Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | 127 |
| (1.505) | Noble Corp Plc | Morgan Stanley | 1.806 | 101 | NV5 Global Inc | Goldman Sachs | 80 |
| 49 | Nordson Corp | Bank of America Merrill Lynch | 79 | (4.435) | nVent Electric Plc | Morgan Stanley | (5.810) |
| 89 | Nordson Corp | Goldman Sachs | 143 | 620 | NVIDIA Corp | Goldman Sachs | 66.140 |
| 70 | Nordson Corp | Morgan Stanley | 151 | 1.504 | NVIDIA Corp | Morgan Stanley | 133.106 |
| 538 | Nordstrom Inc | Bank of America Merrill Lynch | 377 | (17) | NXP Semiconductors NV | Morgan Stanley | (164) |
| 1.001 | Nordstrom Inc | Goldman Sachs | 701 | 1.030 | Oceaneering International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.195) |
| 90 | Norfolk Southern Corp | Goldman Sachs | (455) | 1.449 | Oceaneering International Inc | Goldman Sachs | (1.681) |
| 516 | Norfolk Southern Corp | Morgan Stanley | (5.351) | 44 | OceanFirst Financial Corp | Goldman Sachs | (14) |
| (1.143) | Northern Oil and Gas Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.886 | (44) | ODP Corp | Bank of America Merrill Lynch | 59 |
| (1.621) | Northern Oil and Gas Inc | Goldman Sachs | 2.675 | (455) | ODP Corp | Goldman Sachs | 605 |
| 242 | Northern Trust Corp | Bank of America Merrill Lynch | 276 | (1.435) | Office Properties Income Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (958) |
| 326 | Northern Trust Corp | Morgan Stanley | (342) | (1.370) | Office Properties Income Trust (REIT) | Goldman Sachs | (1.383) |
| (270) | Northfield Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (203) | (2.494) | OGE Energy Corp | Morgan Stanley | 3.142 |
| (416) | Northfield Bancorp Inc | Goldman Sachs | (312) | (17) | O-I Glass Inc [†] | Bank of America Merrill Lynch | — |
| (501) | Northwest Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | 37 | (1.141) | O-I Glass Inc | Goldman Sachs | 11 |
| | | | | 984 | Oil States International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (335) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|-----------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 394 | Oil States International Inc | Goldman Sachs | (134) | (594) | OneSpan Inc | Bank of America | |
| (398) | Okta Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (531) |
| | | Merrill Lynch | (4.943) | (1.125) | OneSpan Inc | Goldman Sachs | (1.136) |
| (914) | Okta Inc | Goldman Sachs | (11.352) | (857) | OneSpaWorld Holdings Ltd | Bank of America | |
| (1.113) | Okta Inc | Morgan Stanley | (5.966) | | | Merrill Lynch | 1.191 |
| (2.044) | Old National Bancorp | Morgan Stanley | 695 | (1.085) | OneSpaWorld Holdings Ltd | Goldman Sachs | 1.508 |
| (250) | Old Republic International Corp | Bank of America | | (41) | Onto Innovation Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 240 | | | Merrill Lynch | (634) |
| (3.640) | Old Republic International Corp | Goldman Sachs | 3.494 | (519) | Onto Innovation Inc | Goldman Sachs | (8.029) |
| (3.127) | Old Republic International Corp | Morgan Stanley | 1.470 | (678) | Onto Innovation Inc | Morgan Stanley | (6.055) |
| | | Bank of America | | (1.594) | Open Lending Corp 'A' | Bank of America | |
| 76 | Old Second Bancorp Inc | Merrill Lynch | 55 | | | Merrill Lynch | (728) |
| | | Goldman Sachs | 712 | (1.942) | Open Lending Corp 'A' | Goldman Sachs | (909) |
| 976 | Old Second Bancorp Inc | Goldman Sachs | 994 | 1.196 | OPENLANE Inc | Bank of America | |
| (198) | Olin Corp | Goldman Sachs | 1.280 | | | Merrill Lynch | (36) |
| (212) | Olin Corp | Morgan Stanley | 1.029 | 747 | OPENLANE Inc | Goldman Sachs | (22) |
| (90) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Bank of America | | (409) | Option Care Health Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.394 | | | Merrill Lynch | (143) |
| (122) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Goldman Sachs | 638 | (63) | Option Care Health Inc | Goldman Sachs | (22) |
| (77) | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Morgan Stanley | 1.006 | (612) | Option Care Health Inc | Morgan Stanley | 563 |
| | | Bank of America | 1.935 | (1.587) | Oracle Corp | Bank of America | |
| (1.458) | Olo Inc 'A' | Merrill Lynch | 2 | | | Merrill Lynch | (5.626) |
| | | Goldman Sachs | 3 | (1.775) | Oracle Corp | Goldman Sachs | (11.371) |
| (2.804) | Olo Inc 'A' | Bank of America | | (1.411) | Oracle Corp | Morgan Stanley | (4.914) |
| 26 | Omega Flex Inc | Merrill Lynch | 1.006 | (73) | OraSure Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | 1.935 | | | Merrill Lynch | 36 |
| 42 | Omega Flex Inc | Bank of America | 2 | (1.942) | OraSure Technologies Inc | Goldman Sachs | 961 |
| (368) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Merrill Lynch | 3 | 44 | O'Reilly Automotive Inc | Bank of America | |
| (367) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | 217 | | | Merrill Lynch | (2.416) |
| (281) | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | Morgan Stanley | (3) | 74 | O'Reilly Automotive Inc | Goldman Sachs | (4.063) |
| 14 | OmniaB Inc' | Bank of America | (14) | 87 | O'Reilly Automotive Inc | Morgan Stanley | (3.286) |
| | | Merrill Lynch | (14) | (685) | Organon & Co | Bank of America | |
| 14 | OmniaB Inc' | Bank of America | (14) | | | Merrill Lynch | 1.206 |
| | | Merrill Lynch | (14) | (1.397) | Organon & Co | Goldman Sachs | 2.459 |
| (3.667) | OmniAb Inc | Goldman Sachs | (2.750) | (683) | Organon & Co | Morgan Stanley | 1.134 |
| 82 | Omniceil Inc | Bank of America | 446 | (241) | Origin Bancorp Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 647 | | | Merrill Lynch | (545) |
| 119 | Omniceil Inc | Goldman Sachs | 918 | (304) | Origin Bancorp Inc | Goldman Sachs | (687) |
| (585) | Omnicom Group Inc | Merrill Lynch | 729 | (379) | Origin Materials Inc | Bank of America | |
| (478) | Omnicom Group Inc | Goldman Sachs | 2.430 | | | Merrill Lynch | 58 |
| (917) | Omnicom Group Inc | Morgan Stanley | 222 | (248) | Orion Engineered Carbons SA | Bank of America | |
| (2.464) | On Holding AG | Morgan Stanley | 69 | | | Merrill Lynch | 211 |
| (24) | ON Semiconductor Corp | Bank of America | (179) | (534) | Orion Engineered Carbons SA | Goldman Sachs | 454 |
| | | Merrill Lynch | (47) | (1.003) | Orion Office Inc (REIT) | Bank of America | |
| (1.786) | ON24 Inc | Merrill Lynch | (114) | | | Merrill Lynch | (130) |
| | | Goldman Sachs | (277) | (627) | Orion Office Inc (REIT) | Goldman Sachs | (69) |
| (467) | ON24 Inc | Bank of America | (428) | (334) | Orthofix Medical Inc | Bank of America | |
| (570) | ONE Gas Inc | Merrill Lynch | (9) | | | Merrill Lynch | — |
| (152) | ONE Gas Inc | Goldman Sachs | 69 | (301) | Orthofix Medical Inc | Goldman Sachs | — |
| (470) | ONE Gas Inc | Morgan Stanley | (179) | (164) | OrthoPediatrics Corp | Bank of America | |
| 98 | One Liberty Properties Inc (REIT) | Bank of America | (47) | | | Merrill Lynch | 323 |
| | | Merrill Lynch | (114) | (203) | OrthoPediatrics Corp | Goldman Sachs | 400 |
| 302 | One Liberty Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (277) | (236) | Oscar Health Inc 'A' | Goldman Sachs | (56) |
| | | Bank of America | (9) | 509 | Oshkosh Corp | Bank of America | |
| 1.896 | OneMain Holdings Inc | Merrill Lynch | 2.813 | | | Merrill Lynch | 300 |
| | | Goldman Sachs | 869 | 256 | Oshkosh Corp | Goldman Sachs | 151 |
| 757 | OneMain Holdings Inc | Morgan Stanley | 573 | 436 | Oshkosh Corp | Morgan Stanley | (78) |
| (67) | ONEOK Inc | Bank of America | 98 | 124 | OSI Systems Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 923 | | | Merrill Lynch | 5 |
| (628) | ONEOK Inc | Goldman Sachs | 544 | 139 | OSI Systems Inc | Goldman Sachs | 6 |
| (338) | ONEOK Inc | Morgan Stanley | | 343 | Otis Worldwide Corp | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (1.585) |
| | | | | 793 | Otis Worldwide Corp | Goldman Sachs | (3.664) |
| | | | | 1.201 | Otis Worldwide Corp | Morgan Stanley | (5.032) |
| | | | | (351) | Otter Tail Corp | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 598 |
| | | | | (319) | Otter Tail Corp | Goldman Sachs | 539 |
| | | | | 2.381 | Outfront Media Inc (REIT) | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (357) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|---|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 1.861 | Outfront Media Inc (REIT) | Goldman Sachs | (279) | (11) | Paylocity Holding Corp | Bank of America | |
| (141) | Outset Medical Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (31) |
| | | Merrill Lynch | (58) | (1.587) | Paymentus Holdings Inc 'A' | Bank of America | |
| (1.235) | Outset Medical Inc | Goldman Sachs | (506) | | | Merrill Lynch | (159) |
| 1.298 | Ovintiv Inc | Morgan Stanley | (3.115) | 1.045 | Payoneer Global Inc | Bank of America | |
| 633 | Owens & Minor Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (455) |
| | | Merrill Lynch | 255 | 1.861 | Payoneer Global Inc | Goldman Sachs | (810) |
| 548 | Owens & Minor Inc | Goldman Sachs | 285 | (20) | PayPal Holdings Inc | Goldman Sachs | (11) |
| 167 | Oxford Industries Inc | Bank of America | | (883) | PayPal Holdings Inc | Morgan Stanley | 194 |
| | | Merrill Lynch | (1.419) | 80 | PC Connection Inc | Bank of America | |
| 309 | Oxford Industries Inc | Goldman Sachs | (2.626) | | | Merrill Lynch | 194 |
| (408) | PACCAR Inc | Bank of America | | 56 | PC Connection Inc | Goldman Sachs | 128 |
| | | Merrill Lynch | 1.155 | (165) | PDF Solutions Inc | Bank of America | |
| (375) | PACCAR Inc | Goldman Sachs | 1.061 | | | Merrill Lynch | (1.104) |
| (1.718) | PACCAR Inc | Morgan Stanley | 2.440 | (320) | PDF Solutions Inc | Goldman Sachs | (2.141) |
| (2.209) | Pacific Biosciences of California Inc | Bank of America | | (38) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 504 | (94) | Peapack-Gladstone Financial Corp | Merrill Lynch | (63) |
| (409) | Pacific Biosciences of California Inc | Goldman Sachs | 101 | | | Goldman Sachs | (157) |
| 460 | Pacira BioSciences Inc | Bank of America | | 142 | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.564) | | | Merrill Lynch | (55) |
| 522 | Pacira BioSciences Inc | Goldman Sachs | (1.775) | 1.977 | Pebblebrook Hotel Trust (REIT) | Goldman Sachs | (761) |
| 998 | PacWest Bancorp | Goldman Sachs | 1.327 | (665) | Pediatrix Medical Group Inc | Bank of America | |
| (870) | Palantir Technologies Inc 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 625 |
| | | Merrill Lynch | (4.150) | (680) | Pediatrix Medical Group Inc | Goldman Sachs | 639 |
| (751) | Palantir Technologies Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.582) | (190) | Pegasystems Inc | Bank of America | |
| (2.329) | Palantir Technologies Inc 'A' | Morgan Stanley | (5.706) | | | Merrill Lynch | (884) |
| 146 | Palo Alto Networks Inc | Bank of America | | (170) | Pegasystems Inc | Goldman Sachs | (791) |
| | | Merrill Lynch | 2.533 | 1.393 | Peloton Interactive Inc 'A' | Bank of America | |
| 175 | Palo Alto Networks Inc | Goldman Sachs | 3.501 | | | Merrill Lynch | (280) |
| 161 | Palo Alto Networks Inc | Morgan Stanley | 3.668 | 91 | Peloton Interactive Inc 'A' | Goldman Sachs | (31) |
| 207 | Palomar Holdings Inc | Bank of America | | 487 | Penn Entertainment Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 916 | | | Merrill Lynch | 261 |
| 145 | Palomar Holdings Inc | Goldman Sachs | 642 | 910 | Penn Entertainment Inc | Morgan Stanley | (137) |
| 75 | Papa John's International Inc | Bank of America | | 125 | Pennant Group Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (270) | | | Merrill Lynch | (61) |
| 314 | Papa John's International Inc | Goldman Sachs | (1.994) | 78 | Pennant Group Inc | Goldman Sachs | (38) |
| 81 | Par Pacific Holdings Inc | Bank of America | | (25) | PennyMac Financial Services Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (75) | (12) | PennyMac Financial Services Inc | Merrill Lynch | (52) |
| 283 | Par Pacific Holdings Inc | Goldman Sachs | (260) | | | Goldman Sachs | 3 |
| (428) | PAR Technology Corp | Bank of America | | (2.316) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (719) | | | Merrill Lynch | (170) |
| (148) | Paragon 28 Inc | Bank of America | | (1.995) | PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT) | Goldman Sachs | (82) |
| | | Merrill Lynch | 22 | 33 | Penske Automotive Group Inc | Goldman Sachs | (10) |
| (171) | Paragon 28 Inc | Goldman Sachs | 26 | 493 | Penske Automotive Group Inc | Morgan Stanley | (601) |
| (1.068) | Paramount Group Inc (REIT) | Bank of America | | (819) | Pentair Plc | Goldman Sachs | 2.457 |
| | | Merrill Lynch | 12 | (1.282) | Pentair Plc | Morgan Stanley | 3.923 |
| 577 | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Bank of America | (335) | 106 | Peoples Bancorp Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | | | | Merrill Lynch | 268 |
| 5.633 | Park Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | (3.267) | 642 | Peoples Bancorp Inc | Goldman Sachs | 1.624 |
| (7) | Park National Corp | Bank of America | | 303 | PepsiCo Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 4 | | | Merrill Lynch | (3.657) |
| (38) | Park National Corp | Goldman Sachs | 20 | 35 | PepsiCo Inc | Goldman Sachs | (56) |
| 25 | Parsons Corp | Bank of America | | 700 | PepsiCo Inc | Morgan Stanley | (2.545) |
| | | Merrill Lynch | 22 | 798 | Perdoceo Education Corp | Bank of America | |
| 504 | Parsons Corp | Goldman Sachs | (198) | | | Merrill Lynch | (32) |
| (136) | Patrick Industries Inc | Bank of America | | 290 | Perdoceo Education Corp | Goldman Sachs | (12) |
| | | Merrill Lynch | 42 | (1.011) | Perella Weinberg Partners | Goldman Sachs | 172 |
| (141) | Patrick Industries Inc | Goldman Sachs | 44 | (189) | Perficient Inc | Bank of America | |
| (281) | Patterson Cos Inc | Goldman Sachs | 348 | | | Merrill Lynch | (558) |
| 681 | Patterson-UTI Energy Inc | Bank of America | | (121) | Perficient Inc | Goldman Sachs | (357) |
| | | Merrill Lynch | (184) | (1.413) | Performance Food Group Co | Bank of America | |
| 1.077 | Patterson-UTI Energy Inc | Goldman Sachs | (291) | | | Merrill Lynch | 5.949 |
| (141) | Paychex Inc | Bank of America | | (1.149) | Performance Food Group Co | Goldman Sachs | 4.837 |
| | | Merrill Lynch | 338 | | | | |
| (57) | Paychex Inc | Goldman Sachs | 112 | | | | |
| (921) | Paycor HCM Inc | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | (58) | | | | |
| (398) | Paycor HCM Inc | Goldman Sachs | (31) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.040) | Performance Food Group Co | Morgan Stanley | 4.223 | 631 | PJT Partners Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.241 |
| (2.208) | Perimeter Solutions SA | Bank of America | | 2.240 | Plains GP Holdings LP 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.705 | 4.704 | Plains GP Holdings LP 'A' | Goldman Sachs | (202) |
| (1.451) | Permian Resources Corp | Bank of America | | (1.629) | Planet Labs PBC | Bank of America | (423) |
| | | Merrill Lynch | 247 | | | Merrill Lynch | (472) |
| (1.771) | Permian Resources Corp | Goldman Sachs | 301 | (2.796) | Planet Labs PBC | Goldman Sachs | (748) |
| (1.074) | Permian Resources Corp | Morgan Stanley | 902 | 1.130 | Playa Hotels & Resorts NV | Goldman Sachs | (119) |
| 2.258 | Petco Health & Wellness Co Inc | Bank of America | | (159) | Plexus Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (6.208) | | | Merrill Lynch | (716) |
| 4.259 | Petco Health & Wellness Co Inc | Goldman Sachs | (12.096) | (396) | Plexus Corp | Goldman Sachs | (1.782) |
| 189 | PetMed Express Inc | Bank of America | | (508) | Pliant Therapeutics Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (93) | | | Merrill Lynch | 467 |
| 520 | PetMed Express Inc | Goldman Sachs | (255) | (452) | Pliant Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 416 |
| (437) | Pfizer Inc | Bank of America | | (1.091) | Plug Power Inc | Goldman Sachs | (796) |
| | | Merrill Lynch | 110 | (713) | Plug Power Inc | Morgan Stanley | 178 |
| (120) | Pfizer Inc | Goldman Sachs | 172 | (524) | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Bank of America | |
| (2.145) | Pfizer Inc | Morgan Stanley | 3.346 | | | Merrill Lynch | (524) |
| (856) | PG&E Corp | Morgan Stanley | (223) | (1.390) | Plymouth Industrial Inc (REIT) | Goldman Sachs | (1.390) |
| (28) | PGT Innovations Inc | Bank of America | | 390 | PMV Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 19 | | | Merrill Lynch | (160) |
| (42) | PGT Innovations Inc | Goldman Sachs | 33 | 322 | PMV Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (132) |
| (106) | Phathom Pharmaceuticals Inc | Bank of America | | 473 | Point Biopharma Global Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 93 | | | Merrill Lynch | (643) |
| (617) | Phathom Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 543 | 1.017 | Point Biopharma Global Inc | Goldman Sachs | (1.383) |
| 28 | Phibro Animal Health Corp 'A' | Bank of America | | 8 | Pool Corp | Bank of America | |
| | | Goldman Sachs | (33) | | | Merrill Lynch | (41) |
| 2.439 | Philip Morris International Inc | Bank of America | | (449) | Popular Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (9.804) | | | Merrill Lynch | (1.015) |
| 1.315 | Philip Morris International Inc | Goldman Sachs | (6.325) | (75) | Popular Inc | Morgan Stanley | 65 |
| 3.467 | Philip Morris International Inc | Morgan Stanley | (8.402) | (556) | Portillo's Inc 'A' | Bank of America | |
| (1.305) | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 500 |
| | | Merrill Lynch | 1.346 | (204) | Portillo's Inc 'A' | Goldman Sachs | 198 |
| (1.550) | Phillips Edison & Co Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.611 | (350) | PotlatchDeltic Corp (REIT) | Bank of America | |
| 1.342 | Photronics Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 249 |
| | | Merrill Lynch | 6.187 | (964) | PotlatchDeltic Corp (REIT) | Goldman Sachs | 684 |
| 1.322 | Photronics Inc | Goldman Sachs | 6.094 | 734 | Power Integrations Inc | Bank of America | |
| (199) | Phreesia Inc | Bank of America | | 525 | Power Integrations Inc | Merrill Lynch | 5.666 |
| | | Merrill Lynch | 342 | 171 | Power Integrations Inc | Goldman Sachs | 4.053 |
| (179) | Phreesia Inc | Goldman Sachs | 240 | (414) | PowerSchool Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 154 |
| (913) | Physicians Realty Trust (REIT) | Bank of America | | (256) | PPG Industries Inc | Goldman Sachs | (377) |
| | | Merrill Lynch | 694 | | | Bank of America | |
| (7.269) | Physicians Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | 5.497 | (33) | PPG Industries Inc | Merrill Lynch | 2.225 |
| (641) | Piedmont Lithium Inc | Bank of America | | (27) | PPG Industries Inc | Goldman Sachs | 287 |
| | | Merrill Lynch | 1.167 | 458 | PPG Industries Inc | Morgan Stanley | 236 |
| (696) | Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT) | Bank of America | | | PPL Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 51 | 849 | PPL Corp | Merrill Lynch | (989) |
| 534 | Pilgrim's Pride Corp | Bank of America | | 1.764 | PPL Corp | Goldman Sachs | (1.834) |
| | | Merrill Lynch | (310) | (662) | PRA Group Inc | Morgan Stanley | (1.852) |
| 426 | Pilgrim's Pride Corp | Goldman Sachs | (247) | | | Merrill Lynch | 259 |
| 205 | Pinnacle Financial Partners Inc | Goldman Sachs | 88 | (777) | PRA Group Inc | Goldman Sachs | 326 |
| 328 | Pinnacle Financial Partners Inc | Morgan Stanley | (436) | 83 | Premier Financial Corp | Bank of America | |
| (31) | Pinnacle West Capital Corp | Goldman Sachs | 104 | | | Merrill Lynch | 17 |
| (219) | Pinnacle West Capital Corp | Morgan Stanley | 199 | 1.119 | Premier Financial Corp | Goldman Sachs | 170 |
| 475 | Pinterest Inc 'A' | Goldman Sachs | 886 | (1.034) | Premier Inc 'A' | Bank of America | |
| 910 | Pinterest Inc 'A' | Morgan Stanley | 596 | | | Merrill Lynch | 2.285 |
| (197) | Piper Sandler Cos | Bank of America | | (302) | Premier Inc 'A' | Goldman Sachs | 667 |
| | | Merrill Lynch | (658) | 120 | Prestige Consumer Healthcare Inc | Bank of America | |
| (116) | Piper Sandler Cos | Goldman Sachs | (387) | 785 | Prestige Consumer Healthcare Inc | Merrill Lynch | (83) |
| (1.257) | Pitney Bowes Inc | Bank of America | | | | Goldman Sachs | (600) |
| | | Merrill Lynch | (327) | 181 | PriceSmart Inc | Bank of America | |
| (1.875) | Pitney Bowes Inc | Goldman Sachs | (488) | | | Merrill Lynch | 371 |
| | | | | 231 | PriceSmart Inc | Goldman Sachs | 511 |
| | | | | (90) | Primerica Inc | Bank of America | |
| | | | | (188) | Primerica Inc | Merrill Lynch | (124) |
| | | | | | | Goldman Sachs | (259) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-----------------|---|---|-------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (98) | Primerica Inc | Morgan Stanley | 237 | (937) | PureCycle Technologies Inc | Bank of America | |
| (171) | Primoris Services Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (262) |
| | | Merrill Lynch | (328) | (2.907) | PureCycle Technologies Inc | Goldman Sachs | (492) |
| (182) | Primoris Services Corp | Goldman Sachs | (349) | (3.875) | Purple Innovation Inc | Goldman Sachs | (2.131) |
| (108) | Privia Health Group Inc | Bank of America | | 82 | PVH Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 186 | | | Merrill Lynch | (16) |
| (1.338) | Privia Health Group Inc | Morgan Stanley | 2.154 | 142 | PVH Corp | Morgan Stanley | (3) |
| (301) | ProAssurance Corp | Bank of America | | 710 | Q2 Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 656 | | | Merrill Lynch | 2.045 |
| (155) | ProAssurance Corp | Goldman Sachs | 338 | 821 | Q2 Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.364 |
| (370) | PROCEPT BioRobotics Corp | Bank of America | | 126 | QCR Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 359 | | | Merrill Lynch | 205 |
| (549) | PROCEPT BioRobotics Corp | Goldman Sachs | 533 | 60 | QCR Holdings Inc | Goldman Sachs | 98 |
| (6) | Procore Technologies Inc | Bank of America | | 79 | Qorvo Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (21) | | | Merrill Lynch | 411 |
| (952) | Procore Technologies Inc | Morgan Stanley | (1.085) | 611 | Qorvo Inc | Goldman Sachs | 3.180 |
| (265) | Procter & Gamble Co | Bank of America | | 265 | Qorvo Inc | Morgan Stanley | 558 |
| | | Merrill Lynch | 1.132 | 146 | Quaker Chemical Corp | Bank of America | |
| (4.556) | ProFrac Holding Corp 'A' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.282) |
| | | Merrill Lynch | (3.672) | 143 | Quaker Chemical Corp | Goldman Sachs | (1.256) |
| (661) | ProFrac Holding Corp 'A' | Goldman Sachs | (575) | 159 | Qualys Inc | Bank of America | |
| 74 | PROG Holdings Inc | Goldman Sachs | 43 | | | Merrill Lynch | 1.436 |
| (221) | Progress Software Corp | Bank of America | | 376 | Qualys Inc | Goldman Sachs | 3.395 |
| | | Merrill Lynch | (809) | 399 | Qualys Inc | Morgan Stanley | 1.652 |
| (235) | Progress Software Corp | Goldman Sachs | (860) | 251 | Quanex Building Products Corp | Bank of America | |
| 32 | Progressive Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 206 |
| | | Merrill Lynch | (35) | 278 | Quanex Building Products Corp | | |
| (456) | Progyny Inc | Goldman Sachs | (866) | | | Goldman Sachs | 228 |
| (941) | Progyny Inc | Morgan Stanley | 772 | 23 | Quanta Services Inc | Bank of America | |
| (370) | ProPetro Holding Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 305 |
| | | Merrill Lynch | (15) | 25 | Quanta Services Inc | Goldman Sachs | 174 |
| (288) | ProPetro Holding Corp | Goldman Sachs | (35) | 22 | Quanta Services Inc | Morgan Stanley | 128 |
| 628 | PROS Holdings Inc | Bank of America | | (167) | Quanterix Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 2.412 | | | Merrill Lynch | (311) |
| 587 | PROS Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.254 | (318) | Quanterix Corp | Goldman Sachs | (763) |
| (223) | Prosperity Bancshares Inc | Bank of America | | 273 | Quest Diagnostics Inc | Goldman Sachs | 216 |
| | | Merrill Lynch | 582 | 445 | Quest Diagnostics Inc | Morgan Stanley | 699 |
| (278) | Prosperity Bancshares Inc | Morgan Stanley | 842 | (158) | Quidel Corp | Goldman Sachs | 242 |
| (338) | Protagonist Therapeutics Inc | Bank of America | | (506) | Quidel Corp | Morgan Stanley | 1.867 |
| | | Merrill Lynch | 230 | (1.959) | R1 RCM Inc | Bank of America | |
| (201) | Protagonist Therapeutics Inc | | | | | Merrill Lynch | 59 |
| | | Goldman Sachs | 137 | (2.000) | R1 RCM Inc | Goldman Sachs | 60 |
| (7.608) | Proterra Inc | Goldman Sachs | 2.206 | (2.536) | R1 RCM Inc | Morgan Stanley | 1.369 |
| (134) | Prothema Corp Plc | Bank of America | | (5.679) | Rackspace Technology Inc | Goldman Sachs | (2.527) |
| | | Merrill Lynch | 1.446 | (577) | Radian Group Inc | Goldman Sachs | (502) |
| (354) | Prothema Corp Plc | Goldman Sachs | 3.466 | (407) | Radian Group Inc | Morgan Stanley | (179) |
| 213 | Proto Labs Inc | Bank of America | | 919 | RadNet Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (179) | | | Merrill Lynch | 983 |
| 216 | Proto Labs Inc | Goldman Sachs | (178) | 136 | RadNet Inc | Goldman Sachs | 146 |
| (299) | Provident Financial Services Inc | Bank of America | | 1.148 | Ralph Lauren Corp | Morgan Stanley | (2.721) |
| | | Merrill Lynch | (230) | (56) | Ramaco Resources Inc | Bank of America | |
| (422) | Provident Financial Services Inc | | | | | Merrill Lynch | 114 |
| | | Goldman Sachs | (384) | (98) | Ramaco Resources Inc | Goldman Sachs | 199 |
| 257 | Prudential Financial Inc | Bank of America | | 171 | Rambus Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 10 | | | Merrill Lynch | 2.409 |
| 149 | Prudential Financial Inc | Goldman Sachs | 6 | 226 | Rambus Inc | Goldman Sachs | 3.184 |
| 320 | Prudential Financial Inc | Morgan Stanley | (819) | 360 | Rambus Inc | Morgan Stanley | 2.228 |
| (134) | PTC Inc | Morgan Stanley | 218 | (833) | Range Resources Corp | Bank of America | |
| 112 | PTC Therapeutics Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (58) |
| | | Merrill Lynch | (1.592) | (317) | Range Resources Corp | Goldman Sachs | (22) |
| 842 | PTC Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (11.965) | (335) | Range Resources Corp | Morgan Stanley | 724 |
| 49 | PTC Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (882) | (344) | Ranger Oil Corp | Bank of America | |
| (267) | Public Service Enterprise Group Inc | | | | | Merrill Lynch | 405 |
| | | Morgan Stanley | 766 | (414) | Ranger Oil Corp | Goldman Sachs | 513 |
| (797) | PubMatic Inc 'A' | Bank of America | | (610) | Ranpak Holdings Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (2.211) | | | Merrill Lynch | 185 |
| (548) | PubMatic Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.814) | (338) | Ranpak Holdings Corp | Goldman Sachs | 122 |
| (800) | Pulmonx Corp | Bank of America | | (151) | Rapid7 Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.224 | | | Merrill Lynch | 121 |
| (1.715) | Pulmonx Corp | Goldman Sachs | 2.624 | (396) | Rapid7 Inc | Goldman Sachs | (490) |
| (599) | PulteGroup Inc | Morgan Stanley | 641 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-----------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (214) | RAPT Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 226 | 537 | Repay Holdings Corp | Goldman Sachs | (548) |
| (78) | RAPT Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 110 | 13 | Repligen Corp | Bank of America Merrill Lynch | 221 |
| 447 | Rayonier Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (259) | 77 | Repligen Corp | Goldman Sachs | 1.307 |
| 879 | Rayonier Inc (REIT) | Goldman Sachs | (531) | 148 | Repligen Corp | Morgan Stanley | 632 |
| (68) | RBC Bearings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.166 | (44) | Republic Services Inc | Goldman Sachs | 253 |
| (167) | RBC Bearings Inc | Goldman Sachs | 2.864 | (249) | Republic Services Inc | Morgan Stanley | 473 |
| (482) | RBC Bearings Inc | Morgan Stanley | 6.030 | (1.326) | Resideo Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 570 |
| 9 | RCI Hospitality Holdings Inc | Goldman Sachs | (10) | (1.688) | Resideo Technologies Inc | Goldman Sachs | 726 |
| 169 | RE/MAX Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (22) | (558) | Resources Connection Inc | Bank of America Merrill Lynch | (79) |
| 780 | RE/MAX Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (101) | (568) | Resources Connection Inc | Goldman Sachs | (36) |
| (963) | Ready Capital Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 152 | 2.835 | Retail Opportunity Investments Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.162) |
| (6.083) | Ready Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | 852 | 548 | Retail Opportunity Investments Corp (REIT) | Goldman Sachs | (225) |
| (143) | Recursion Pharmaceuticals Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 15 | (379) | REV Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (57) |
| 1.171 | Red Rock Resorts Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.417) | (2.183) | REV Group Inc | Goldman Sachs | (327) |
| 470 | Red Rock Resorts Inc 'A' | Goldman Sachs | (569) | 102 | Revance Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (354) |
| 286 | Redfin Corp | Bank of America Merrill Lynch | (346) | 48 | Revance Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (148) |
| 2.020 | Redfin Corp | Goldman Sachs | (2.307) | (393) | REVOLUTION Medicines Inc | Bank of America Merrill Lynch | 495 |
| (564) | Redwood Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (118) | (342) | REVOLUTION Medicines Inc | Goldman Sachs | 431 |
| (659) | Redwood Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (60) | 856 | Revolve Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.123) |
| (189) | Regal Rexnord Corp | Bank of America Merrill Lynch | (532) | 1.069 | Revolve Group Inc | Goldman Sachs | (2.651) |
| (147) | Regal Rexnord Corp | Goldman Sachs | (431) | (42) | Revvity Inc | Goldman Sachs | 5 |
| (244) | Regal Rexnord Corp | Morgan Stanley | 364 | (22) | Revvity Inc | Morgan Stanley | 29 |
| (54) | Regency Centers Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 174 | 703 | REX American Resources Corp | Bank of America Merrill Lynch | 3.379 |
| (188) | Regency Centers Corp (REIT) | Morgan Stanley | 476 | 292 | REX American Resources Corp | Goldman Sachs | 1.478 |
| 13 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (248) | 39 | Rexford Industrial Realty Inc (REIT) | Goldman Sachs | 25 |
| 20 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (382) | (10) | Reynolds Consumer Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9 |
| 39 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (766) | (756) | Reynolds Consumer Products Inc | Goldman Sachs | 711 |
| 884 | REGENXBIO Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.943) | (48) | RH | Goldman Sachs | 607 |
| 847 | REGENXBIO Inc | Goldman Sachs | (3.406) | (129) | RH | Morgan Stanley | 608 |
| (605) | Regions Financial Corp | Goldman Sachs | (944) | (500) | Rhythm Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (14) |
| (1.035) | Regions Financial Corp | Morgan Stanley | (217) | (2.962) | Rimini Street Inc | Goldman Sachs | (2.192) |
| (154) | Reinsurance Group of America Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.311 | 1.497 | RingCentral Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 10.085 |
| 121 | Relay Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (50) | 1.375 | RingCentral Inc 'A' | Goldman Sachs | 8.650 |
| 243 | Relay Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (138) | (1.850) | Rithm Capital Corp (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (259) |
| 77 | Reliance Steel & Aluminum Co | Bank of America Merrill Lynch | (662) | (5.834) | Rithm Capital Corp (REIT) | Goldman Sachs | (817) |
| 186 | Reliance Steel & Aluminum Co | Morgan Stanley | (2.303) | (11.550) | Rithm Capital Corp (REIT) | Morgan Stanley | 462 |
| (514) | Remitly Global Inc | Bank of America Merrill Lynch | 771 | (1.602) | Rivian Automotive Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.051) |
| (488) | Remitly Global Inc | Goldman Sachs | 732 | (628) | Rivian Automotive Inc 'A' | Goldman Sachs | (804) |
| 46 | RenaissanceRe Holdings Ltd | Bank of America Merrill Lynch | (648) | (1.402) | Rivian Automotive Inc 'A' | Morgan Stanley | (687) |
| 69 | RenaissanceRe Holdings Ltd | Goldman Sachs | (972) | (172) | RLI Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.030 |
| 99 | RenaissanceRe Holdings Ltd | Morgan Stanley | 63 | (142) | RLI Corp | Goldman Sachs | 641 |
| (412) | Renasant Corp | Bank of America Merrill Lynch | (737) | (213) | RLI Corp | Morgan Stanley | 675 |
| (108) | Renasant Corp | Goldman Sachs | (193) | 2.250 | RLJ Lodging Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.147) |
| 983 | Repay Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (1.003) | 5.175 | RLJ Lodging Trust (REIT) | Goldman Sachs | (2.639) |
| | | | | 487 | RMR Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 83 |
| | | | | 886 | RMR Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 151 |
| | | | | 380 | Robert Half International Inc | Morgan Stanley | (1.064) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-------------------------------|---|---|---|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (6.729) | Robinhood Markets Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (2.221) | 2.697 | Sabra Health Care Inc (REIT) | Goldman Sachs | (975) |
| (3.703) | Robinhood Markets Inc 'A' | Morgan Stanley | (815) | (1.162) | Sabre Corp | Bank of America Merrill Lynch | 401 |
| 119 | ROBLOX Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 124 | (2.749) | Sabre Corp | Goldman Sachs | 578 |
| 406 | ROBLOX Corp 'A' | Goldman Sachs | 568 | 655 | Safehold Inc (REIT) | Goldman Sachs | (2.168) |
| 1.057 | ROBLOX Corp 'A' | Morgan Stanley | 863 | (112) | Safety Insurance Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (510) |
| (11.633) | Rocket Lab USA Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.317) | (388) | Safety Insurance Group Inc | Goldman Sachs | (1.765) |
| (5.423) | Rocket Lab USA Inc | Goldman Sachs | (1.112) | (93) | Sage Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | 301 |
| (318) | Rocket Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 366 | (477) | Sage Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.545 |
| (262) | Rocket Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 235 | 13 | Saia Inc | Morgan Stanley | 116 |
| (54) | Rockwell Automation Inc | Morgan Stanley | 53 | (189) | Salesforce Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.017) |
| (7) | Rogers Corp | Bank of America Merrill Lynch | 21 | (342) | Salesforce Inc | Goldman Sachs | (5.831) |
| (155) | Rogers Corp | Goldman Sachs | 87 | (300) | Salesforce Inc | Morgan Stanley | (3.073) |
| (1.374) | Roivant Sciences Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 48 | (304) | Sally Beauty Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 9 |
| (1.561) | Roivant Sciences Ltd | Goldman Sachs | 55 | (697) | Sally Beauty Holdings Inc | Goldman Sachs | 21 |
| (382) | Roku Inc | Morgan Stanley | (260) | (900) | Samsara Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 765 |
| 974 | Rollins Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.248) | (266) | Samsara Inc 'A' | Goldman Sachs | 188 |
| 442 | Rollins Inc | Goldman Sachs | (1.474) | (629) | Samsara Inc 'A' | Morgan Stanley | 535 |
| 331 | Rollins Inc | Morgan Stanley | (561) | 128 | Sana Biotechnology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (52) |
| (798) | Rover Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 215 | (101) | SandRidge Energy Inc | Goldman Sachs | 8 |
| (2.953) | Rover Group Inc | Goldman Sachs | 797 | (207) | Sandy Spring Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (120) |
| 98 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 399 | (230) | Sandy Spring Bancorp Inc | Goldman Sachs | (133) |
| 672 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Goldman Sachs | 1.696 | 1 | Sangamo Therapeutics Inc" | Bank of America Merrill Lynch | — |
| 487 | Royal Caribbean Cruises Ltd | Morgan Stanley | 503 | 1.979 | Sanmina Corp | Goldman Sachs | 8.153 |
| 178 | Royal Gold Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.666) | 11 | SBA Communications Corp (REIT) | Goldman Sachs | (162) |
| 132 | Royal Gold Inc | Goldman Sachs | (1.977) | 143 | SBA Communications Corp (REIT) | Morgan Stanley | (2.277) |
| 210 | Royal Gold Inc | Morgan Stanley | (1.378) | 335 | ScanSource Inc | Bank of America Merrill Lynch | (47) |
| (402) | RPC Inc | Bank of America Merrill Lynch | 99 | 415 | ScanSource Inc | Goldman Sachs | (58) |
| 212 | RPT Realty (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 23 | 1.698 | Schneider National Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | (726) |
| 819 | RPT Realty (REIT) | Goldman Sachs | 90 | 833 | Schneider National Inc 'B' | Goldman Sachs | (364) |
| 806 | Rush Enterprises Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 161 | 729 | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (539) |
| 774 | Rush Enterprises Inc 'A' | Goldman Sachs | 155 | 1.099 | Schnitzer Steel Industries Inc 'A' | Goldman Sachs | (791) |
| 236 | Rush Enterprises Inc 'B' | Bank of America Merrill Lynch | 205 | (381) | Scholastic Corp | Bank of America Merrill Lynch | (264) |
| 442 | Rush Enterprises Inc 'B' | Goldman Sachs | 385 | (433) | Scholastic Corp | Goldman Sachs | (191) |
| (547) | RXO Inc | Bank of America Merrill Lynch | (799) | (222) | Schrodinger Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.607) |
| (922) | RXO Inc | Goldman Sachs | (1.346) | (784) | Schrodinger Inc | Goldman Sachs | (5.676) |
| (724) | Ryan Specialty Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.925 | (89) | Science Applications International Corp | Goldman Sachs | 153 |
| (695) | Ryan Specialty Holdings Inc | Goldman Sachs | 2.808 | (265) | Science Applications International Corp | Morgan Stanley | 244 |
| (1.282) | Ryan Specialty Holdings Inc | Morgan Stanley | 5.397 | 1.106 | Scotts Miracle-Gro Co | Bank of America Merrill Lynch | (4.255) |
| (251) | Ryerson Holding Corp | Bank of America Merrill Lynch | 171 | 579 | Scotts Miracle-Gro Co | Goldman Sachs | (2.035) |
| (285) | Ryerson Holding Corp | Goldman Sachs | 194 | 717 | Scotts Miracle-Gro Co | Morgan Stanley | (3.089) |
| (346) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.315 | (618) | Sea Ltd ADR | Bank of America Merrill Lynch | 14.235 |
| (545) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 2.071 | (280) | Sea Ltd ADR | Goldman Sachs | 8.422 |
| (624) | Ryman Hospitality Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | 1.129 | (453) | Sea Ltd ADR | Morgan Stanley | 4.521 |
| (704) | S&T Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (621) | (4) | Seaboard Corp | Goldman Sachs | (116) |
| (462) | S&T Bancorp Inc | Goldman Sachs | (281) | (295) | Seacoast Banking Corp of Florida | Bank of America Merrill Lynch | (434) |
| 1.299 | Sabra Health Care Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (598) | (345) | Seacoast Banking Corp of Florida | Goldman Sachs | (507) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---------------------------------------|-----------------|---|---|----------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 137 | Seagate Technology Holdings Plc | Morgan Stanley | (269) | 46 | Shoe Carnival Inc | Bank of America | |
| (374) | Sealed Air Corp | Bank of America | | 396 | Shutterstock Inc | Merrill Lynch | (1) |
| | | Merrill Lynch | 1.646 | | | Bank of America | (2.022) |
| (1.392) | Sealed Air Corp | Goldman Sachs | 6.125 | 847 | Shutterstock Inc | Merrill Lynch | (4.738) |
| (93) | Sealed Air Corp | Morgan Stanley | 348 | 60 | Shyft Group Inc | Goldman Sachs | |
| (1.740) | Seer Inc | Goldman Sachs | (783) | | | Bank of America | |
| 44 | SEI Investments Co | Bank of America | | 306 | Shyft Group Inc | Merrill Lynch | 13 |
| | | Merrill Lynch | (26) | (384) | SI-BONE Inc | Goldman Sachs | 64 |
| 47 | SEI Investments Co | Goldman Sachs | (51) | | | Bank of America | |
| (174) | Select Medical Holdings Corp | Bank of America | | (409) | SI-BONE Inc | Merrill Lynch | (159) |
| | | Merrill Lynch | 188 | (134) | SIGA Technologies Inc | Goldman Sachs | (170) |
| (1.007) | Select Medical Holdings Corp | | | | | Bank of America | |
| (2.378) | Select Water Solutions Inc | Goldman Sachs | 1.088 | 17 | Signet Jewelers Ltd | Merrill Lynch | (8) |
| | | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 567 | 290 | Signet Jewelers Ltd | Merrill Lynch | (125) |
| (1.910) | Select Water Solutions Inc | Goldman Sachs | 417 | (830) | Silgan Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.142) |
| (386) | Selective Insurance Group Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.436 | (348) | Silgan Holdings Inc | Merrill Lynch | 1.838 |
| (71) | Selective Insurance Group Inc | | | 225 | Silicon Laboratories Inc | Goldman Sachs | 804 |
| (220) | Selective Insurance Group Inc | Goldman Sachs | 264 | | | Bank of America | |
| 224 | SEMrush Holdings Inc 'A' | Morgan Stanley | 836 | 3 | Silicon Laboratories Inc | Merrill Lynch | 1.764 |
| | | Bank of America | | 139 | Silicon Laboratories Inc | Goldman Sachs | 24 |
| | | Merrill Lynch | (276) | 328 | Silk Road Medical Inc | Morgan Stanley | 393 |
| 630 | SEMrush Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (775) | | | Bank of America | |
| 796 | Semtech Corp | Bank of America | | 684 | Silk Road Medical Inc | Merrill Lynch | (1.489) |
| | | Merrill Lynch | 1.469 | (671) | SilverBow Resources Inc | Goldman Sachs | (3.105) |
| 2.198 | Semtech Corp | Bank of America | 5.111 | | | Bank of America | |
| 7 | Seneca Foods Corp 'A' | Goldman Sachs | | (1.207) | Simmons First National Corp 'A' | Merrill Lynch | 513 |
| | | Merrill Lynch | 4 | | | Bank of America | (1.376) |
| 10 | Seneca Foods Corp 'A' | Goldman Sachs | 6 | (725) | Simmons First National Corp 'A' | Merrill Lynch | (827) |
| 414 | Sensient Technologies Corp | Bank of America | | (832) | Simply Good Foods Co | Goldman Sachs | |
| | | Merrill Lynch | (1.035) | | | Bank of America | |
| 116 | Sensient Technologies Corp | | | (593) | Simply Good Foods Co | Merrill Lynch | 2.987 |
| (768) | SentinelOne Inc 'A' | Goldman Sachs | (290) | 205 | Simpson Manufacturing Co Inc | Goldman Sachs | 2.129 |
| | | Bank of America | | | | Goldman Sachs | (1.062) |
| | | Merrill Lynch | (2.273) | 110 | Simulations Plus Inc | Bank of America | |
| (1.341) | SentinelOne Inc 'A' | Goldman Sachs | (3.969) | | | Bank of America | |
| (4.700) | SentinelOne Inc 'A' | Morgan Stanley | (9.870) | 121 | Simulations Plus Inc | Merrill Lynch | 481 |
| (1.085) | Seritage Growth Properties 'A' (REIT) | Bank of America | | (105) | Sinclair Broadcast Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 529 |
| | | Merrill Lynch | 9 | | | Bank of America | |
| 1.312 | Service Properties Trust (REIT) | Bank of America | | 3.065 | Sirius XM Holdings Inc | Merrill Lynch | 98 |
| | | Merrill Lynch | — | 921 | Sirius XM Holdings Inc | Goldman Sachs | 31 |
| 1.009 | Service Properties Trust (REIT) | | — | (747) | SiriusPoint Ltd | Morgan Stanley | 46 |
| | | Goldman Sachs | — | | | Bank of America | |
| 334 | ServisFirst Bancshares Inc | Bank of America | | (2.826) | SITE Centers Corp (REIT) | Merrill Lynch | (269) |
| | | Merrill Lynch | (199) | | | Bank of America | |
| 64 | ServisFirst Bancshares Inc | Goldman Sachs | (36) | (2.588) | SITE Centers Corp (REIT) | Merrill Lynch | 763 |
| (108) | SES AI Corp | Goldman Sachs | (3) | 103 | SiteOne Landscape Supply Inc | Goldman Sachs | 699 |
| (195) | Shake Shack Inc 'A' | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 957 | 53 | SiteOne Landscape Supply Inc | Merrill Lynch | (1.167) |
| (74) | Shake Shack Inc 'A' | Goldman Sachs | 7 | | | Goldman Sachs | (600) |
| (381) | Shenandoah Telecommunications Co | Bank of America | | 141 | SiteOne Landscape Supply Inc | | |
| | | Merrill Lynch | 65 | (84) | SiTime Corp | Morgan Stanley | (1.316) |
| (797) | Shenandoah Telecommunications Co | | | | | Bank of America | |
| (9) | Shift4 Payments Inc 'A' | Goldman Sachs | 135 | (223) | SiTime Corp | Merrill Lynch | (1.221) |
| | | Bank of America | | (1.523) | Sitio Royalties Corp 'A' | Goldman Sachs | (3.242) |
| | | Merrill Lynch | 5 | 235 | Six Flags Entertainment Corp | Morgan Stanley | 1.721 |
| (441) | Shift4 Payments Inc 'A' | Morgan Stanley | 1.641 | | | Bank of America | |
| (353) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Bank of America | | 241 | Six Flags Entertainment Corp | Merrill Lynch | (367) |
| (1.524) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | Merrill Lynch | 411 | | | Goldman Sachs | (376) |
| | | Goldman Sachs | 1.775 | (161) | SJW Group | Bank of America | |
| (472) | Shoals Technologies Group Inc 'A' | | | | | Merrill Lynch | (37) |
| (31) | Shockwave Medical Inc | Morgan Stanley | 290 | (635) | SJW Group | Goldman Sachs | (146) |
| | | Bank of America | | 111 | Skechers USA Inc 'A' | Goldman Sachs | (8) |
| | | Merrill Lynch | 105 | 76 | Skechers USA Inc 'A' | Morgan Stanley | (2) |
| (24) | Shockwave Medical Inc | Morgan Stanley | 183 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------|-------------------------------|---|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (521) | Skyline Champion Corp | Bank of America Merrill Lynch | 6.288 | (419) | SouthState Corp | Bank of America Merrill Lynch | (997) |
| (748) | Skyline Champion Corp | Goldman Sachs | 9.028 | (191) | SouthState Corp | Goldman Sachs | (455) |
| (188) | Skyline Champion Corp | Morgan Stanley | 1.842 | (797) | SouthState Corp | Morgan Stanley | 1.084 |
| 103 | SkyWest Inc | Bank of America Merrill Lynch | 373 | 1.848 | Southwest Airlines Co | Morgan Stanley | 1.072 |
| 478 | SkyWest Inc | Goldman Sachs | 1.730 | (136) | Southwest Gas Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (420) |
| (364) | Skyworks Solutions Inc | Morgan Stanley | (655) | (302) | Southwest Gas Holdings Inc | Goldman Sachs | (933) |
| (484) | SLM Corp | Bank of America Merrill Lynch | (189) | (475) | Southwest Gas Holdings Inc | Morgan Stanley | (456) |
| (347) | SLM Corp | Goldman Sachs | (135) | 1.660 | Southwestern Energy Co | Goldman Sachs | (647) |
| (1.642) | SLM Corp | Morgan Stanley | (525) | 913 | Sovos Brands Inc | Bank of America Merrill Lynch | 199 |
| 425 | SM Energy Co | Morgan Stanley | (850) | 890 | Sovos Brands Inc | Goldman Sachs | 363 |
| 65 | SmartFinancial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 120 | 1.908 | SpartanNash Co | Bank of America Merrill Lynch | (332) |
| 28 | SmartFinancial Inc | Goldman Sachs | 52 | 1.475 | SpartanNash Co | Goldman Sachs | (201) |
| (1.576) | SmartRent Inc | Bank of America Merrill Lynch | — | (483) | Spectrum Brands Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 420 |
| (1.131) | SmartRent Inc | Goldman Sachs | — | (143) | Spectrum Brands Holdings Inc | Goldman Sachs | 124 |
| (123) | Smartsheet Inc 'A' | Goldman Sachs | (485) | (257) | Sphere Entertainment Co | Bank of America Merrill Lynch | (491) |
| (205) | Smartsheet Inc 'A' | Morgan Stanley | (269) | (130) | Sphere Entertainment Co | Goldman Sachs | (248) |
| 1.117 | Snap Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.430 | (136) | Spire Inc | Goldman Sachs | 426 |
| 2.228 | Snap Inc 'A' | Morgan Stanley | 490 | (428) | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (710) |
| (42) | Snap One Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | 47 | (635) | Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | (854) |
| (86) | Snap One Holdings Corp | Goldman Sachs | 95 | 534 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (801) |
| 105 | Snap-on Inc | Bank of America Merrill Lynch | (508) | 93 | Sportsman's Warehouse Holdings Inc | Goldman Sachs | (140) |
| 30 | Snap-on Inc | Goldman Sachs | (145) | 27 | Spotify Technology SA | Bank of America Merrill Lynch | 105 |
| 172 | Snap-on Inc | Morgan Stanley | (1.440) | 68 | Spotify Technology SA | Goldman Sachs | 45 |
| (386) | Snowflake Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.554 | 317 | Spotify Technology SA | Morgan Stanley | (111) |
| (82) | Snowflake Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.449) | (715) | SpringWorks Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 2.009 |
| (436) | Snowflake Inc 'A' | Morgan Stanley | 5.655 | 617 | Sprinklr Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 944 |
| (3.240) | SoFi Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (6.318) | 1.348 | Sprinklr Inc 'A' | Goldman Sachs | 2.062 |
| (2.623) | SoFi Technologies Inc | Morgan Stanley | (3.830) | 57 | Sprout Social Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (18) |
| (137) | SolarEdge Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.687 | 302 | Sprout Social Inc 'A' | Goldman Sachs | (95) |
| (224) | SolarEdge Technologies Inc | Goldman Sachs | 4.393 | (69) | Sprouts Farmers Market Inc | Bank of America Merrill Lynch | 54 |
| (227) | SolarEdge Technologies Inc | Morgan Stanley | 2.467 | (591) | Sprouts Farmers Market Inc | Goldman Sachs | 650 |
| 681 | SolarWinds Corp | Bank of America Merrill Lynch | 354 | 695 | SPX Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.311 |
| 642 | SolarWinds Corp | Goldman Sachs | 334 | 616 | SPX Technologies Inc | Goldman Sachs | 2.048 |
| (3.169) | Solid Power Inc | Goldman Sachs | (887) | 432 | Squarespace Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 415 |
| (1.379) | SomaLogic Inc | Bank of America Merrill Lynch | 262 | 116 | Squarespace Inc 'A' | Goldman Sachs | 111 |
| (3.256) | SomaLogic Inc | Goldman Sachs | 619 | (1.755) | SS&C Technologies Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.966 |
| 210 | Sonic Automotive Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (7) | (1.687) | SS&C Technologies Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.857 |
| 138 | Sonic Automotive Inc 'A' | Goldman Sachs | 62 | (1.755) | SS&C Technologies Holdings Inc | Morgan Stanley | 3.440 |
| (80) | Sonoco Products Co | Bank of America Merrill Lynch | (59) | (355) | St Joe Co | Bank of America Merrill Lynch | (1.356) |
| (289) | Sonoco Products Co | Goldman Sachs | (214) | (570) | St Joe Co | Goldman Sachs | (2.177) |
| (87) | Sonoco Products Co | Morgan Stanley | (3) | 54 | STAAR Surgical Co | Bank of America Merrill Lynch | (261) |
| 333 | Sonos Inc | Bank of America Merrill Lynch | (130) | 398 | STAAR Surgical Co | Goldman Sachs | (1.786) |
| 91 | Sonos Inc | Goldman Sachs | 58 | (1.829) | STAG Industrial Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 311 |
| (314) | Sotera Health Co | Bank of America Merrill Lynch | 306 | (1.403) | STAG Industrial Inc (REIT) | Goldman Sachs | 239 |
| (52) | Sotera Health Co | Goldman Sachs | 66 | (1.399) | STAG Industrial Inc (REIT) | Morgan Stanley | (70) |
| (33) | SoundThinking Inc | Goldman Sachs | (115) | | | | |
| (972) | Southern Co | Bank of America Merrill Lynch | 2.708 | | | | |
| (1.967) | Southern Co | Goldman Sachs | 5.543 | | | | |
| (1.721) | Southern Co | Morgan Stanley | 2.461 | | | | |
| (355) | Southside Bancshares Inc | Bank of America Merrill Lynch | (11) | | | | |
| (147) | Southside Bancshares Inc | Goldman Sachs | (4) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------------------------------|-------------------------------|---|---|--|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 543 | Standard Motor Products Inc | Bank of America Merrill Lynch | (493) | 1.067 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (363) |
| 366 | Standard Motor Products Inc | Goldman Sachs | (316) | 24 | Summit Materials Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (28) |
| 135 | Standex International Corp | Goldman Sachs | 219 | 1.171 | Summit Materials Inc 'A' | Goldman Sachs | (749) |
| (58) | Stanley Black & Decker Inc | Goldman Sachs | 135 | (200) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | (129) |
| (482) | Stanley Black & Decker Inc | Morgan Stanley | 2.405 | (525) | Sun Country Airlines Holdings Inc | Goldman Sachs | (339) |
| 476 | Star Holdings | Bank of America Merrill Lynch | (538) | 361 | Sunnova Energy International Inc | Goldman Sachs | 531 |
| 646 | Star Holdings | Goldman Sachs | (730) | 120 | SunPower Corp | Bank of America Merrill Lynch | 45 |
| (482) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (487) | 67 | SunPower Corp | Goldman Sachs | 20 |
| (156) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | (158) | 339 | Sunrun Inc | Bank of America Merrill Lynch | 381 |
| (3.110) | Starwood Property Trust Inc (REIT) | Morgan Stanley | (529) | (448) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 121 |
| (148) | State Street Corp | Bank of America Merrill Lynch | (20) | (1.429) | Sunstone Hotel Investors Inc (REIT) | Goldman Sachs | 386 |
| (256) | State Street Corp | Goldman Sachs | 12 | 33 | Super Micro Computer Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.860 |
| (263) | State Street Corp | Morgan Stanley | (62) | 1.114 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.515) |
| 120 | Steel Dynamics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (728) | 909 | Supernus Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (1.212) |
| 106 | Steel Dynamics Inc | Goldman Sachs | (435) | (160) | Surgery Partners Inc | Bank of America Merrill Lynch | 6 |
| 233 | Steel Dynamics Inc | Morgan Stanley | (1.096) | (397) | Surgery Partners Inc | Goldman Sachs | 16 |
| 1.400 | Steelcase Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (914) | (160) | Surgery Partners Inc | Morgan Stanley | 339 |
| 1.254 | Steelcase Inc 'A' | Goldman Sachs | (813) | 21 | Surmodics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (15) |
| (161) | Stellar Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (177) | 21 | Surmodics Inc | Goldman Sachs | (15) |
| (389) | Stellar Bancorp Inc | Goldman Sachs | (428) | (13) | SVB Financial Group | Goldman Sachs | 1 |
| (6.277) | Stem Inc | Bank of America Merrill Lynch | (4.768) | (1.831) | Sweetgreen Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 200 |
| (3.832) | Stem Inc | Goldman Sachs | (2.951) | (128) | Sylvamo Corp | Bank of America Merrill Lynch | 250 |
| 67 | Stepan Co | Bank of America Merrill Lynch | 151 | (57) | Sylvamo Corp | Goldman Sachs | 97 |
| 48 | Stepan Co | Goldman Sachs | 108 | (183) | Synaptics Inc | Morgan Stanley | (703) |
| (248) | StepStone Group Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 149 | 476 | Synchrony Financial | Bank of America Merrill Lynch | 1.311 |
| (387) | StepStone Group Inc 'A' | Goldman Sachs | 232 | 1.310 | Synchrony Financial | Goldman Sachs | 2.199 |
| (134) | Stericycle Inc | Bank of America Merrill Lynch | 125 | 1.688 | Synchrony Financial | Morgan Stanley | 1.249 |
| (522) | Stericycle Inc | Goldman Sachs | 488 | (1.092) | Syndax Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.256 |
| 604 | Sterling Infrastructure Inc | Bank of America Merrill Lynch | 2.416 | (425) | Syndax Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 489 |
| 545 | Sterling Infrastructure Inc | Goldman Sachs | 2.180 | 41 | Synopsys Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.143 |
| (503) | Steven Madden Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 785 | 220 | Synopsys Inc | Goldman Sachs | 18.685 |
| (545) | Steven Madden Ltd | Goldman Sachs | 850 | 97 | Synopsys Inc | Morgan Stanley | 5.682 |
| (14) | Stewart Information Services Corp | Bank of America Merrill Lynch | 4 | 406 | Synovus Financial Corp | Morgan Stanley | (227) |
| 744 | Stifel Financial Corp | Morgan Stanley | (2.262) | (413) | Sysco Corp | Bank of America Merrill Lynch | 1.812 |
| (966) | Stitch Fix Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 148 | (185) | Sysco Corp | Goldman Sachs | 821 |
| (160) | Stock Yards Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | (88) | (632) | Sysco Corp | Morgan Stanley | 1.277 |
| (591) | Stock Yards Bancorp Inc | Goldman Sachs | (556) | (100) | Take-Two Interactive Software Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.268) |
| 439 | Stoke Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (430) | (450) | Take-Two Interactive Software Inc | Morgan Stanley | (225) |
| 157 | Stoneridge Inc | Bank of America Merrill Lynch | 229 | (478) | Talos Energy Inc | Goldman Sachs | (20) |
| 314 | Stoneridge Inc | Goldman Sachs | 458 | 740 | Tandem Diabetes Care Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.655) |
| 44 | StoneX Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | (273) | 451 | Tandem Diabetes Care Inc | Goldman Sachs | (2.499) |
| 75 | StoneX Group Inc | Goldman Sachs | (465) | (1.264) | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (1.232) |
| (555) | Strategic Education Inc | Goldman Sachs | 1.487 | (919) | Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT) | Goldman Sachs | (874) |
| (545) | Stride Inc | Bank of America Merrill Lynch | 944 | 760 | Tapestry Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.835) |
| (239) | Stride Inc | Goldman Sachs | 440 | | | | |
| 9 | Stryker Corp | Bank of America Merrill Lynch | (22) | | | | |
| 1.230 | Summit Hotel Properties Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (418) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--|-----------------|---|---|---------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 122 | Tapestry Inc | Goldman Sachs | (455) | 512 | Theravance Biopharma Inc | Goldman Sachs | (123) |
| 96 | Tapestry Inc | Morgan Stanley | (275) | 60 | Thor Industries Inc | Bank of America | |
| (115) | Target Hospitality Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (107) |
| | | Merrill Lynch | 129 | 142 | Thor Industries Inc | Goldman Sachs | (253) |
| (397) | TaskUS Inc 'A' | Bank of America | | 127 | Thor Industries Inc | Morgan Stanley | (415) |
| | | Merrill Lynch | 164 | 321 | Thryv Holdings Inc | Bank of America | |
| (687) | TaskUS Inc 'A' | Goldman Sachs | 419 | | | Merrill Lynch | 491 |
| 131 | TD SYNEX Corp | Goldman Sachs | 114 | 179 | Thryv Holdings Inc | Goldman Sachs | 274 |
| 543 | TD SYNEX Corp | Morgan Stanley | (847) | (461) | Tidewater Inc | Bank of America | |
| (1.090) | TDCX Inc ADR | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (106) |
| | | Merrill Lynch | (360) | (457) | Tidewater Inc | Goldman Sachs | (105) |
| (420) | TDCX Inc ADR | Goldman Sachs | (139) | (221) | TimkenSteel Corp | Bank of America | |
| 51 | TE Connectivity Ltd | Morgan Stanley | 161 | | | Merrill Lynch | 2 |
| 369 | TechTarget Inc | Bank of America | | (404) | TimkenSteel Corp | Goldman Sachs | 4 |
| | | Merrill Lynch | 1.424 | 271 | Titan Machinery Inc | Bank of America | |
| 666 | TechTarget Inc | Goldman Sachs | 2.571 | | | Merrill Lynch | (2.222) |
| (124) | Tejon Ranch Co | Bank of America | | 520 | Titan Machinery Inc | Goldman Sachs | (4.264) |
| | | Merrill Lynch | 11 | (92) | TJX Cos Inc | Bank of America | |
| (411) | Tejon Ranch Co | Goldman Sachs | 37 | | | Merrill Lynch | 59 |
| 15 | Teledyne Technologies Inc | Bank of America | | (450) | Toast Inc 'A' | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (87) | | | Merrill Lynch | (995) |
| 32 | Teledyne Technologies Inc | Morgan Stanley | (98) | (2.467) | Toast Inc 'A' | Morgan Stanley | (839) |
| 220 | Teleflex Inc | Morgan Stanley | (2.959) | 46 | Tompkins Financial Corp | Bank of America | |
| 501 | Telephone and Data Systems Inc | Goldman Sachs | 19 | 12 | Tompkins Financial Corp | Merrill Lynch | 109 |
| 930 | Tempur Sealy International Inc | Goldman Sachs | (2.288) | (373) | Tootsie Roll Industries Inc | Goldman Sachs | 28 |
| | | | | | | Bank of America | |
| 150 | Tempur Sealy International Inc | Morgan Stanley | (191) | (511) | Tootsie Roll Industries Inc | Merrill Lynch | (578) |
| (128) | Tenable Holdings Inc | Bank of America | | (788) | Towne Bank | Goldman Sachs | (792) |
| | | Merrill Lynch | (260) | | | Bank of America | |
| (43) | Tenable Holdings Inc | Goldman Sachs | (87) | (707) | Towne Bank | Merrill Lynch | (1.371) |
| (28) | Tennant Co | Bank of America | | (210) | TPG Inc | Goldman Sachs | (1.230) |
| | | Merrill Lynch | 135 | | | Bank of America | |
| (203) | Tennant Co | Goldman Sachs | 980 | (448) | TPG Inc | Merrill Lynch | 468 |
| 1.647 | Teradata Corp | Bank of America | | 989 | TPG RE Finance Trust Inc (REIT) | Goldman Sachs | 846 |
| | | Merrill Lynch | 4.332 | | | Bank of America | |
| 306 | Teradata Corp | Goldman Sachs | 699 | (1.243) | TPI Composites Inc | Merrill Lynch | 762 |
| 1.320 | Teradata Corp | Morgan Stanley | 2.159 | | | Bank of America | |
| 605 | Teradyne Inc | Bank of America | | (1.602) | TPI Composites Inc | Merrill Lynch | (75) |
| | | Merrill Lynch | 4.471 | 19 | Tractor Supply Co | Goldman Sachs | (96) |
| 1.507 | Teradyne Inc | Goldman Sachs | 11.137 | | | Bank of America | |
| 1.347 | Teradyne Inc | Morgan Stanley | 5.119 | 59 | Tractor Supply Co | Merrill Lynch | (73) |
| 69 | Terex Corp | Bank of America | | 34 | Tractor Supply Co | Goldman Sachs | (58) |
| | | Merrill Lynch | (107) | (803) | Trade Desk Inc 'A' | Morgan Stanley | (383) |
| 88 | Terex Corp | Goldman Sachs | (119) | | | Bank of America | |
| (50) | Terreno Realty Corp (REIT) | Bank of America | | (790) | Trade Desk Inc 'A' | Merrill Lynch | (4.344) |
| | | Merrill Lynch | 26 | (1.414) | Trade Desk Inc 'A' | Goldman Sachs | (4.566) |
| (928) | Terreno Realty Corp (REIT) | Morgan Stanley | (111) | (44) | Tradeweb Markets Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.753) |
| 56 | Tesla Inc | Morgan Stanley | 960 | (293) | Traeger Inc | Morgan Stanley | 21 |
| (128) | Tetra Tech Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 997 | (5.159) | Traeger Inc | Merrill Lynch | (34) |
| (90) | Tetra Tech Inc | Goldman Sachs | 701 | 98 | Transcat Inc | Goldman Sachs | (1.599) |
| (243) | Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR | Goldman Sachs | 233 | | | Bank of America | |
| (377) | Texas Capital Bancshares Inc | Bank of America | | 47 | Transcat Inc | Merrill Lynch | 215 |
| | | Merrill Lynch | (1.142) | (148) | TransMedics Group Inc | Goldman Sachs | 103 |
| (168) | Texas Capital Bancshares Inc | Goldman Sachs | (509) | | | Bank of America | |
| 30 | Texas Pacific Land Corp | Bank of America | | (160) | TransMedics Group Inc | Merrill Lynch | 471 |
| | | Merrill Lynch | (2.237) | 4.139 | Transocean Ltd | Goldman Sachs | 509 |
| 12 | Texas Pacific Land Corp | Goldman Sachs | (895) | | | Bank of America | |
| 23 | Texas Pacific Land Corp | Morgan Stanley | (1.597) | 4.015 | Transocean Ltd | Merrill Lynch | 352 |
| 34 | Texas Roadhouse Inc | Bank of America | | 1.038 | Transocean Ltd | Goldman Sachs | 341 |
| | | Merrill Lynch | (16) | (45) | TransUnion | Morgan Stanley | (400) |
| 146 | Texas Roadhouse Inc | Morgan Stanley | (654) | (57) | TransUnion | Goldman Sachs | (126) |
| (1.483) | TFS Financial Corp | Bank of America | | 2.398 | Travel + Leisure Co | Morgan Stanley | 2 |
| | | Merrill Lynch | (168) | 221 | Travere Therapeutics Inc | Morgan Stanley | (48) |
| (2.568) | TFS Financial Corp | Goldman Sachs | (243) | | | Bank of America | |
| 267 | Theravance Biopharma Inc | Bank of America | | 1.684 | Travere Therapeutics Inc | Merrill Lynch | 111 |
| | | Merrill Lynch | (64) | 261 | Treace Medical Concepts Inc | Goldman Sachs | 842 |
| | | | | 211 | Treace Medical Concepts Inc | Bank of America | 141 |
| | | | | | | Merrill Lynch | 114 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|--------------------------|-----------------|---|---|---------------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (4.448) | Tredegar Corp | Goldman Sachs | 1.334 | (63) | Twilio Inc 'A' | Bank of America | |
| (239) | TreeHouse Foods Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (1.223) |
| | | Merrill Lynch | 1.011 | (883) | Twilio Inc 'A' | Goldman Sachs | (17.148) |
| (583) | TreeHouse Foods Inc | Goldman Sachs | 2.466 | (1.174) | Twilio Inc 'A' | Morgan Stanley | (10.672) |
| 1.053 | Trex Co Inc | Bank of America | | 591 | Twist Bioscience Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (5.455) | | | Merrill Lynch | 898 |
| 359 | Trex Co Inc | Goldman Sachs | (1.860) | 719 | Twist Bioscience Corp | Goldman Sachs | 1.093 |
| 244 | Trex Co Inc | Morgan Stanley | (1.032) | (813) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Bank of America | |
| 178 | Tri Pointe Homes Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (423) |
| | | Merrill Lynch | (7) | (1.050) | Two Harbors Investment Corp (REIT) | Goldman Sachs | (546) |
| 811 | Tri Pointe Homes Inc | Goldman Sachs | (32) | 239 | Tyson Foods Inc 'A' | Goldman Sachs | 385 |
| (38) | TriCo Bancshares | Bank of America | | (50) | UDR Inc (REIT) | Goldman Sachs | 93 |
| | | Merrill Lynch | (60) | (53) | UFP Industries Inc | Goldman Sachs | 166 |
| (242) | TriCo Bancshares | Goldman Sachs | (385) | (65) | UFP Industries Inc | Morgan Stanley | 202 |
| (104) | TriMas Corp | Bank of America | | (74) | UFP Technologies Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 7 | | | Merrill Lynch | (366) |
| (123) | TriMas Corp | Goldman Sachs | 9 | (31) | UFP Technologies Inc | Goldman Sachs | (153) |
| 863 | Trimble Inc | Bank of America | | 220 | UGI Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (544) | | | Merrill Lynch | (139) |
| 965 | Trimble Inc | Goldman Sachs | (608) | 727 | UGI Corp | Goldman Sachs | (458) |
| 585 | Trimble Inc | Morgan Stanley | (842) | 895 | UGI Corp | Morgan Stanley | (644) |
| (156) | TriNet Group Inc | Bank of America | | (497) | U-Haul Holding Co | Morgan Stanley | 4.329 |
| | | Merrill Lynch | 656 | (4.197) | UiPath Inc 'A' | Morgan Stanley | (1.301) |
| (381) | TriNet Group Inc | Goldman Sachs | 1.850 | 55 | Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc | Morgan Stanley | (3.583) |
| (236) | TriNet Group Inc | Morgan Stanley | 1.115 | (607) | Ultra Clean Holdings Inc | Bank of America | |
| 531 | Trinity Industries Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (4.043) |
| | | Merrill Lynch | 122 | (568) | Ultra Clean Holdings Inc | Goldman Sachs | (3.783) |
| 828 | Trinity Industries Inc | Goldman Sachs | 147 | 640 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Bank of America | |
| 482 | Trinseo Plc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (237) |
| | | Merrill Lynch | (1.138) | 13 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs | (27) |
| 321 | Trinseo Plc | Goldman Sachs | (758) | (135) | UMB Financial Corp | Goldman Sachs | (217) |
| 745 | TripAdvisor Inc | Bank of America | | (528) | UMH Properties Inc (REIT) | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (626) | | | Merrill Lynch | 338 |
| (124) | Triumph Financial Inc | Bank of America | | (1.709) | UMH Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.094 |
| | | Merrill Lynch | (383) | (1.464) | Under Armour Inc 'A' | Bank of America | |
| (124) | Triumph Financial Inc | Goldman Sachs | (383) | (237) | Under Armour Inc 'A' | Merrill Lynch | 871 |
| 348 | Triumph Group Inc | Bank of America | | (193) | Under Armour Inc 'A' | Goldman Sachs | 141 |
| | | Merrill Lynch | 191 | (2.038) | Under Armour Inc 'C' | Morgan Stanley | 61 |
| 398 | Triumph Group Inc | Goldman Sachs | 219 | | | Bank of America | |
| (853) | Tronox Holdings Plc | Bank of America | | 1.128 | Under Armour Inc 'C' | Merrill Lynch | (1.182) |
| | | Merrill Lynch | 280 | (188) | UniFirst Corp | Goldman Sachs | (654) |
| (1.886) | Tronox Holdings Plc | Goldman Sachs | 641 | (43) | Union Pacific Corp | Goldman Sachs | (1.117) |
| (271) | TrueBlue Inc | Bank of America | | | | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (377) | 944 | uniQure NV | Bank of America | |
| (631) | TrueBlue Inc | Goldman Sachs | (877) | | | Merrill Lynch | 19 |
| 178 | Truist Financial Corp | Bank of America | | (10) | Union Pacific Corp | Goldman Sachs | 14 |
| | | Merrill Lynch | 620 | (172) | Union Pacific Corp | Morgan Stanley | 708 |
| 356 | Truist Financial Corp | Goldman Sachs | 870 | 481 | uniQure NV | Bank of America | |
| 1.119 | Truist Financial Corp | Morgan Stanley | 60 | | | Merrill Lynch | (1.284) |
| (316) | Trupanion Inc | Bank of America | | 211 | United Airlines Holdings Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (471) | | | Merrill Lynch | 319 |
| (304) | Trustmark Corp | Bank of America | | (1.151) | United Bankshares Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (135) | | | Merrill Lynch | (1.427) |
| (635) | Trustmark Corp | Goldman Sachs | (283) | (171) | United Bankshares Inc | Goldman Sachs | (212) |
| (100) | TTEC Holdings Inc | Bank of America | | (1.095) | United Community Banks Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 191 | (326) | United Community Banks Inc | Merrill Lynch | (1.577) |
| (188) | TTEC Holdings Inc | Goldman Sachs | 359 | | | Goldman Sachs | (469) |
| 800 | TTM Technologies Inc | Bank of America | | 629 | United Fire Group Inc | Goldman Sachs | (1.321) |
| | | Merrill Lynch | 728 | (690) | United Natural Foods Inc | Bank of America | |
| 216 | TTM Technologies Inc | Goldman Sachs | 197 | | | Merrill Lynch | (117) |
| (296) | Tucows Inc 'A' | Bank of America | | (390) | United Natural Foods Inc | Goldman Sachs | (66) |
| | | Merrill Lynch | (1.447) | 19 | United Parcel Service Inc 'B' | Goldman Sachs | (71) |
| (7) | Tucows Inc 'A' | Goldman Sachs | (40) | 465 | United Parcel Service Inc 'B' | Morgan Stanley | (1.869) |
| 2.483 | Turning Point Brands Inc | Bank of America | | (32) | United Rentals Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (627) | | | Merrill Lynch | (47) |
| 2.091 | Turning Point Brands Inc | Goldman Sachs | (631) | (1) | United Rentals Inc | Goldman Sachs | (1) |
| 1.565 | Tutor Perini Corp | Bank of America | | | | | |
| | | Merrill Lynch | 391 | | | | |
| 1.584 | Tutor Perini Corp | Goldman Sachs | 396 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|---|-----------------|---|---|------------------------------|-----------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (66) | United Rentals Inc | Morgan Stanley | 515 | 612 | USANA Health Sciences Inc | Bank of America | |
| 1.315 | United States Cellular Corp | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (2.148) |
| | | Merrill Lynch | (513) | 341 | USANA Health Sciences Inc | Goldman Sachs | (1.197) |
| 277 | United States Cellular Corp | Goldman Sachs | (108) | 438 | Utz Brands Inc | Bank of America | |
| 2.438 | United States Steel Corp | Goldman Sachs | (1.487) | | | Merrill Lynch | (263) |
| 1.459 | United States Steel Corp | Morgan Stanley | (1.269) | 338 | Utz Brands Inc | Goldman Sachs | (203) |
| 18 | United Therapeutics Corp | Bank of America | | (106) | V2X Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (102) | | | Merrill Lynch | 73 |
| 170 | United Therapeutics Corp | Goldman Sachs | (830) | (94) | V2X Inc | Goldman Sachs | 65 |
| 97 | United Therapeutics Corp | Morgan Stanley | (954) | (893) | VAALCO Energy Inc | Bank of America | |
| 106 | UnitedHealth Group Inc | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (94) |
| | | Merrill Lynch | (565) | (899) | VAALCO Energy Inc | Goldman Sachs | (94) |
| 223 | UnitedHealth Group Inc | Goldman Sachs | (1.664) | 181 | Vail Resorts Inc | Morgan Stanley | (85) |
| 145 | UnitedHealth Group Inc | Morgan Stanley | (327) | 85 | Valero Energy Corp | Bank of America | |
| 732 | Uniti Group Inc (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | (417) |
| | | Merrill Lynch | (81) | 139 | Valero Energy Corp | Morgan Stanley | (666) |
| 2.073 | Uniti Group Inc (REIT) | Goldman Sachs | (228) | (3.116) | Valley National Bancorp | Morgan Stanley | — |
| 412 | Unitil Corp | Bank of America | | (410) | Valvoline Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | (1.751) | | | Merrill Lynch | 90 |
| 619 | Unitil Corp | Goldman Sachs | (2.631) | (1.732) | Valvoline Inc | Goldman Sachs | 381 |
| 76 | Unity Software Inc | Morgan Stanley | 69 | (629) | Valvoline Inc | Morgan Stanley | 346 |
| (454) | Universal Corp | Bank of America | | 841 | Vanda Pharmaceuticals Inc | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 259 | | | Merrill Lynch | (278) |
| (1.134) | Universal Corp | Goldman Sachs | 640 | 2.081 | Vanda Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (687) |
| 96 | Universal Display Corp | Bank of America | | 883 | Varex Imaging Corp | Bank of America | |
| | | Merrill Lynch | 1.047 | | | Merrill Lynch | (556) |
| 26 | Universal Display Corp | Goldman Sachs | 284 | 1.083 | Varex Imaging Corp | Goldman Sachs | (682) |
| 51 | Universal Display Corp | Morgan Stanley | (76) | 578 | Varonis Systems Inc | Bank of America | |
| (312) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 936 |
| | | Merrill Lynch | 409 | 487 | Varonis Systems Inc | Goldman Sachs | 789 |
| (444) | Universal Health Realty Income Trust (REIT) | Goldman Sachs | 582 | (77) | Vaxcyte Inc | Bank of America | |
| (247) | Universal Health Services Inc 'B' | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 114 |
| | | Merrill Lynch | 2.134 | (55) | Vaxcyte Inc | Morgan Stanley | 33 |
| (321) | Universal Health Services Inc 'B' | Goldman Sachs | 2.773 | 6.307 | Vector Group Ltd | Bank of America | |
| (171) | Universal Health Services Inc 'B' | Morgan Stanley | 995 | | | Merrill Lynch | 3.114 |
| (163) | Universal Logistics Holdings Inc | Bank of America | | 5.967 | Vector Group Ltd | Goldman Sachs | 3.043 |
| | | Merrill Lynch | (250) | 2.013 | Veeco Instruments Inc | Bank of America | |
| (49) | Universal Logistics Holdings Inc | Goldman Sachs | (75) | | | Merrill Lynch | 5.194 |
| 119 | Univest Financial Corp | Bank of America | | 1.590 | Veeco Instruments Inc | Goldman Sachs | 4.102 |
| | | Merrill Lynch | 168 | 57 | Veeva Systems Inc 'A' | Bank of America | |
| 680 | Univest Financial Corp | Goldman Sachs | 959 | | | Merrill Lynch | (648) |
| (324) | Upbound Group Inc | Bank of America | | 70 | Veeva Systems Inc 'A' | Goldman Sachs | (796) |
| | | Merrill Lynch | 645 | 468 | Veeva Systems Inc 'A' | Morgan Stanley | (70) |
| (1.137) | Upbound Group Inc | Goldman Sachs | 2.263 | (1.259) | Velo3D Inc | Bank of America | |
| (116) | Upwork Inc | Goldman Sachs | (8) | | | Merrill Lynch | 13 |
| 566 | Urban Edge Properties (REIT) | Bank of America | | (2.094) | Velo3D Inc | Goldman Sachs | 21 |
| | | Merrill Lynch | (611) | (136) | Ventyx Biosciences Inc | Bank of America | |
| 91 | Urban Edge Properties (REIT) | Goldman Sachs | (98) | | | Merrill Lynch | 219 |
| (1.544) | Urban Outfitters Inc | Bank of America | | (402) | Ventyx Biosciences Inc | Goldman Sachs | 647 |
| | | Merrill Lynch | (6.145) | 405 | Veracyte Inc | Goldman Sachs | 203 |
| (465) | Urban Outfitters Inc | Goldman Sachs | (1.629) | 5.988 | Veradigm Inc | Bank of America | |
| (535) | Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT) | Bank of America | | | | Merrill Lynch | 30 |
| | | Merrill Lynch | (1.300) | 319 | Vericel Corp | Bank of America | |
| (470) | Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT) | Goldman Sachs | (1.142) | | | Merrill Lynch | (297) |
| 1.344 | US Bancorp | Bank of America | | 307 | Vericel Corp | Goldman Sachs | (286) |
| | | Merrill Lynch | 612 | 482 | Verint Systems Inc | Goldman Sachs | 790 |
| 815 | US Bancorp | Goldman Sachs | 416 | (1.659) | Veris Residential Inc (REIT) | Bank of America | |
| 1.537 | US Bancorp | Morgan Stanley | (1.153) | | | Merrill Lynch | 130 |
| 57 | US Physical Therapy Inc | Bank of America | | (3.794) | Veris Residential Inc (REIT) | Goldman Sachs | 446 |
| | | Merrill Lynch | (683) | 1.208 | VeriSign Inc | Bank of America | |
| 76 | US Physical Therapy Inc | Goldman Sachs | (911) | | | Merrill Lynch | (1.703) |
| 2.565 | US Silica Holdings Inc | Bank of America | | 422 | VeriSign Inc | Goldman Sachs | (595) |
| | | Merrill Lynch | (2.437) | 1.166 | VeriSign Inc | Morgan Stanley | (4.501) |
| 2.639 | US Silica Holdings Inc | Goldman Sachs | (2.507) | (110) | Verisk Analytics Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | (14) |
| | | | | (104) | Verisk Analytics Inc | Morgan Stanley | (118) |
| | | | | 287 | Veritex Holdings Inc | Goldman Sachs | 387 |
| | | | | 58 | Veritiv Corp | Goldman Sachs | (404) |
| | | | | (1.434) | Verizon Communications Inc | Bank of America | |
| | | | | | | Merrill Lynch | 2.137 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---|---|------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (2.051) | Verra Mobility Corp | Bank of America Merrill Lynch | (287) | (1.424) | Vista Outdoor Inc | Goldman Sachs | 1.631 |
| (1.326) | Verra Mobility Corp | Goldman Sachs | (186) | 105 | Visteon Corp | Bank of America Merrill Lynch | (222) |
| (743) | Vertex Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 62 | 17 | Visteon Corp | Goldman Sachs | (36) |
| 62 | Vertex Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 136 | 92 | Visteon Corp | Morgan Stanley | (627) |
| 270 | Vertex Inc 'A' | Goldman Sachs | 594 | 3.086 | Vistra Corp | Morgan Stanley | (2.531) |
| 73 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.788) | 131 | Vita Coco Co Inc | Bank of America Merrill Lynch | 222 |
| 16 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | (392) | 480 | Vita Coco Co Inc | Goldman Sachs | 658 |
| 88 | Vertex Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley | (1.355) | (44) | Vital Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | 23 |
| (2.083) | Vertiv Holdings Co | Bank of America Merrill Lynch | (7.520) | (193) | Vital Energy Inc | Goldman Sachs | 101 |
| (548) | Vertiv Holdings Co | Goldman Sachs | (1.978) | 529 | Vital Farms Inc | Bank of America Merrill Lynch | (265) |
| (2.627) | Vertiv Holdings Co | Morgan Stanley | (6.357) | 554 | Vital Farms Inc | Goldman Sachs | (277) |
| 84 | Viad Corp | Bank of America Merrill Lynch | 46 | (201) | Vitesse Energy Inc | Bank of America Merrill Lynch | (798) |
| 169 | Viad Corp | Goldman Sachs | 55 | (392) | Vivid Seats Inc 'A' | Goldman Sachs | 29 |
| (149) | Viasat Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.143) | (468) | Vontier Corp | Bank of America Merrill Lynch | (529) |
| (541) | Viasat Inc | Goldman Sachs | (4.149) | (3.877) | Vontier Corp | Goldman Sachs | (4.381) |
| (229) | Viatrix Inc | Goldman Sachs | 60 | (3.388) | Vontier Corp | Morgan Stanley | (1.186) |
| (1.053) | Viavi Solutions Inc | Bank of America Merrill Lynch | (748) | (257) | Vornado Realty Trust (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (2) |
| (1.570) | Viavi Solutions Inc | Goldman Sachs | (1.115) | (69) | Vornado Realty Trust (REIT) | Goldman Sachs | (54) |
| 145 | VICI Properties Inc (REIT) | Goldman Sachs | (189) | (56) | Voya Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | 92 |
| 583 | VICI Properties Inc (REIT) | Morgan Stanley | (635) | (168) | Voya Financial Inc | Morgan Stanley | 438 |
| 155 | Vicor Corp | Bank of America Merrill Lynch | 2.230 | (125) | VSE Corp | Bank of America Merrill Lynch | 36 |
| 250 | Vicor Corp | Goldman Sachs | 3.598 | (122) | VSE Corp | Goldman Sachs | 35 |
| (608) | Victoria's Secret & Co | Bank of America Merrill Lynch | 2.895 | 237 | Vulcan Materials Co | Bank of America Merrill Lynch | (310) |
| (708) | Victoria's Secret & Co | Goldman Sachs | 3.667 | 99 | Vulcan Materials Co | Goldman Sachs | (130) |
| 784 | Victory Capital Holdings Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | — | 148 | Vulcan Materials Co | Morgan Stanley | (355) |
| 814 | Victory Capital Holdings Inc 'A' | Goldman Sachs | — | (748) | Vuzix Corp | Bank of America Merrill Lynch | (957) |
| (1.547) | Viking Therapeutics Inc | Goldman Sachs | 1.773 | (1.233) | Vuzix Corp | Goldman Sachs | (1.578) |
| 474 | Vimeo Inc | Bank of America Merrill Lynch | 66 | 270 | W R Berkley Corp | Bank of America Merrill Lynch | (724) |
| 259 | Vimeo Inc | Goldman Sachs | 36 | 460 | W R Berkley Corp | Goldman Sachs | (1.233) |
| (246) | Vir Biotechnology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (182) | 127 | W R Berkley Corp | Morgan Stanley | (258) |
| (624) | Vir Biotechnology Inc | Goldman Sachs | (462) | (325) | W&T Offshore Inc | Bank of America Merrill Lynch | 98 |
| (446) | Vir Biotechnology Inc | Morgan Stanley | (285) | (151) | W&T Offshore Inc | Goldman Sachs | 45 |
| (891) | Virgin Galactic Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 526 | 806 | Wabash National Corp | Bank of America Merrill Lynch | (185) |
| (2.840) | Virgin Galactic Holdings Inc | Goldman Sachs | 1.431 | 544 | Wabash National Corp | Goldman Sachs | (125) |
| (475) | Viridian Therapeutics Inc | Bank of America Merrill Lynch | (152) | 1.586 | Walgreens Boots Alliance Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.467) |
| (820) | Viridian Therapeutics Inc | Goldman Sachs | (262) | 3.102 | Walgreens Boots Alliance Inc | Goldman Sachs | (4.197) |
| 121 | Virtu Financial Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (35) | 2.516 | Walgreens Boots Alliance Inc | Morgan Stanley | (2.231) |
| 665 | Virtu Financial Inc 'A' | Goldman Sachs | (193) | 126 | Walker & Dunlop Inc | Bank of America Merrill Lynch | 467 |
| 236 | Virtu Financial Inc 'A' | Morgan Stanley | (99) | 403 | Walker & Dunlop Inc | Goldman Sachs | 1.495 |
| 5 | Virtus Investment Partners Inc | Bank of America Merrill Lynch | 95 | 113 | Walmart Inc | Bank of America Merrill Lynch | (756) |
| 4 | Virtus Investment Partners Inc | Goldman Sachs | 76 | 224 | Walmart Inc | Goldman Sachs | (1.499) |
| 649 | Visa Inc 'A' | Goldman Sachs | (9.999) | 471 | Walmart Inc | Morgan Stanley | (1.601) |
| 1.275 | Visa Inc 'A' | Morgan Stanley | (17.213) | 561 | Warby Parker Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (516) |
| (3.528) | Vishay Intertechnology Inc | Bank of America Merrill Lynch | (5.543) | 651 | Warby Parker Inc 'A' | Goldman Sachs | (599) |
| (2.080) | Vishay Intertechnology Inc | Goldman Sachs | (3.268) | 605 | Warner Bros Discovery Inc | Bank of America Merrill Lynch | (823) |
| 42 | Vishay Precision Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 29 | 296 | Warner Bros Discovery Inc | Goldman Sachs | (403) |
| 269 | Vishay Precision Group Inc | Goldman Sachs | 186 | (1.039) | Warner Music Group Corp 'A' | Morgan Stanley | 2.359 |
| (802) | Vista Outdoor Inc | Bank of America Merrill Lynch | 938 | 471 | Warrior Met Coal Inc | Goldman Sachs | (1.922) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------------|-------------------------------|---|---|---------------------------------------|-------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| (991) | Washington Federal Inc | Bank of America Merrill Lynch | (654) | 1.121 | Whitestone (REIT) | Goldman Sachs | 303 |
| (1.074) | Washington Federal Inc | Goldman Sachs | (631) | (57) | WideOpenWest Inc | Bank of America Merrill Lynch | 25 |
| 342 | Washington Trust Bancorp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 889 | (270) | WideOpenWest Inc | Goldman Sachs | 116 |
| 733 | Washington Trust Bancorp Inc | Goldman Sachs | 1.906 | 358 | Willis Towers Watson Plc | Bank of America Merrill Lynch | (4.174) |
| 88 | Waters Corp | Goldman Sachs | (2.002) | 79 | Willis Towers Watson Plc | Goldman Sachs | (921) |
| 154 | Waters Corp | Morgan Stanley | (2.658) | 96 | Willis Towers Watson Plc | Morgan Stanley | (1.139) |
| (44) | Waterstone Financial Inc | Bank of America Merrill Lynch | (25) | 301 | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Goldman Sachs | 105 |
| (31) | Waterstone Financial Inc | Goldman Sachs | (17) | 365 | WillScot Mobile Mini Holdings Corp | Morgan Stanley | (91) |
| 1 | Watsco Inc | Goldman Sachs | (4) | (78) | Wingstop Inc | Bank of America Merrill Lynch | 689 |
| 209 | Watsco Inc | Morgan Stanley | 805 | (101) | Wingstop Inc | Morgan Stanley | 685 |
| 42 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (127) | 119 | Winmark Corp | Bank of America Merrill Lynch | 625 |
| 75 | Watts Water Technologies Inc 'A' | Goldman Sachs | (105) | 189 | Winmark Corp | Goldman Sachs | 992 |
| (116) | WD-40 Co | Bank of America Merrill Lynch | (66) | (125) | Winnebago Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | 31 |
| (36) | WD-40 Co | Goldman Sachs | (21) | (67) | Winnebago Industries Inc | Goldman Sachs | 17 |
| (582) | Webster Financial Corp | Bank of America Merrill Lynch | (801) | 118 | Wix.com Ltd | Goldman Sachs | (286) |
| (992) | Webster Financial Corp | Goldman Sachs | (1.688) | 503 | Wix.com Ltd | Morgan Stanley | (1.569) |
| (477) | Webster Financial Corp | Morgan Stanley | 647 | (2.470) | Wolverine World Wide Inc | Bank of America Merrill Lynch | 5.236 |
| (167) | WEC Energy Group Inc | Bank of America Merrill Lynch | 164 | (411) | Wolverine World Wide Inc | Goldman Sachs | 871 |
| (202) | WEC Energy Group Inc | Morgan Stanley | 194 | 41 | Woodward Inc | Bank of America Merrill Lynch | (93) |
| 230 | Weis Markets Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.114) | 63 | Woodward Inc | Goldman Sachs | (142) |
| 223 | Weis Markets Inc | Goldman Sachs | (2.049) | 24 | Woodward Inc | Morgan Stanley | (73) |
| (142) | Wells Fargo & Co | Bank of America Merrill Lynch | (176) | 171 | Workday Inc 'A' | Goldman Sachs | 4.005 |
| (280) | Wells Fargo & Co | Goldman Sachs | (347) | (4.310) | Workhorse Group Inc | Goldman Sachs | 142 |
| (2.368) | Wells Fargo & Co | Morgan Stanley | 2.297 | 266 | Workiva Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.705 |
| (889) | Welltower Inc (REIT) | Morgan Stanley | 2.729 | 50 | Workiva Inc | Goldman Sachs | 321 |
| 101 | Wendy's Co | Bank of America Merrill Lynch | (189) | 102 | Workiva Inc | Morgan Stanley | 20 |
| (401) | Werner Enterprises Inc | Bank of America Merrill Lynch | 345 | 64 | World Acceptance Corp | Bank of America Merrill Lynch | 687 |
| (379) | Werner Enterprises Inc | Goldman Sachs | 326 | 37 | World Acceptance Corp | Goldman Sachs | 397 |
| (60) | WESCO International Inc | Bank of America Merrill Lynch | (485) | 1.502 | World Fuel Services Corp | Bank of America Merrill Lynch | (506) |
| (127) | WESCO International Inc | Goldman Sachs | (1.026) | 1.370 | World Fuel Services Corp | Goldman Sachs | (450) |
| (214) | WESCO International Inc | Morgan Stanley | (1.308) | 161 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (930) |
| (123) | Westamerica BanCorp | Bank of America Merrill Lynch | (165) | 226 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Goldman Sachs | (1.305) |
| (411) | Westamerica BanCorp | Goldman Sachs | (483) | 512 | World Wrestling Entertainment Inc 'A' | Morgan Stanley | (269) |
| 105 | Western Alliance Bancorp | Bank of America Merrill Lynch | (97) | 115 | Worthington Industries Inc | Bank of America Merrill Lynch | (17) |
| 92 | Western Digital Corp | Morgan Stanley | 153 | 34 | Worthington Industries Inc | Goldman Sachs | (58) |
| (2.225) | Western Union Co | Morgan Stanley | 1.891 | 83 | WP Carey Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | (208) |
| 320 | Westlake Corp | Bank of America Merrill Lynch | (3.133) | 332 | WP Carey Inc (REIT) | Goldman Sachs | (833) |
| 161 | Westlake Corp | Goldman Sachs | (1.388) | 228 | WP Carey Inc (REIT) | Morgan Stanley | (141) |
| 476 | Westlake Corp | Morgan Stanley | (5.015) | 23 | WW Grainger Inc | Bank of America Merrill Lynch | (265) |
| 863 | Westrock Co | Morgan Stanley | 9 | 37 | WW Grainger Inc | Goldman Sachs | (444) |
| 213 | WEX Inc | Bank of America Merrill Lynch | (2.416) | 35 | WW Grainger Inc | Morgan Stanley | (660) |
| 120 | WEX Inc | Goldman Sachs | (1.438) | (30) | Xcel Energy Inc | Goldman Sachs | 25 |
| 320 | WEX Inc | Morgan Stanley | (4.788) | (408) | Xcel Energy Inc | Morgan Stanley | 649 |
| 998 | Weyerhaeuser Co (REIT) | Morgan Stanley | (878) | 216 | Xencor Inc | Bank of America Merrill Lynch | (197) |
| (65) | Whirlpool Corp | Bank of America Merrill Lynch | 163 | 941 | Xencor Inc | Goldman Sachs | (856) |
| (378) | Whirlpool Corp | Morgan Stanley | 998 | (1.391) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 1.331 |
| (6) | White Mountains Insurance Group Ltd | Bank of America Merrill Lynch | 238 | (1.462) | Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT) | Goldman Sachs | 1.447 |
| (40) | White Mountains Insurance Group Ltd | Goldman Sachs | 1.585 | (806) | Xenon Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 2.470 |
| 2.004 | Whitestone (REIT) | Bank of America Merrill Lynch | 541 | 1.683 | Xerox Holdings Corp | Bank of America Merrill Lynch | (959) |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|-------------------------------|----------------------------------|---|---|-----------------------------|----------------------------------|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | | Vereinigte Staaten von Amerika Fortsetzung | | | |
| 3.776 | Xerox Holdings Corp | Goldman Sachs | (2.152) | (37) | Zscaler Inc | Morgan Stanley | (297) |
| (1.063) | Xometry Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | (1.210) | 820 | Zumiez Inc | Bank of America Merrill Lynch | (193) |
| (161) | XPEL Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.158 | 918 | Zumiez Inc | Goldman Sachs | (216) |
| (86) | XPEL Inc | Goldman Sachs | 618 | (135) | Zuora Inc 'A' | Bank of America | |
| (893) | Xperi Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.755) | (94) | Zuora Inc 'A' ^{††} | Merrill Lynch Goldman Sachs | (13) |
| (491) | Xperi Inc | Goldman Sachs | (1.031) | | | | (6.783) |
| (360) | XPO Inc | Bank of America Merrill Lynch | (47) | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – USD 177.194.878) | | | 42.676 |
| (449) | XPO Inc | Goldman Sachs | (104) | * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | |
| (750) | XPO Inc | Morgan Stanley | (210) | †† Beträge mit einem Wert unter USD 0,5 wurden auf null abgerundet. | | | |
| (387) | Xponential Fitness Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 1.238 | | | | |
| (482) | Xponential Fitness Inc 'A' | Goldman Sachs | 1.542 | | | | |
| 31 | Xylem Inc | Bank of America Merrill Lynch | (123) | | | | |
| 45 | Xylem Inc | Goldman Sachs | (179) | | | | |
| 1.113 | Xylem Inc | Morgan Stanley | (4.096) | | | | |
| 1.063 | Yelp Inc | Bank of America Merrill Lynch | 3.030 | | | | |
| 2.270 | Yelp Inc | Goldman Sachs | 6.470 | | | | |
| (198) | YETI Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 67 | | | | |
| (172) | YETI Holdings Inc | Goldman Sachs | 139 | | | | |
| (123) | YETI Holdings Inc | Morgan Stanley | 252 | | | | |
| 672 | Yext Inc | Bank of America Merrill Lynch | 820 | | | | |
| 2.149 | Yext Inc | Goldman Sachs | 2.622 | | | | |
| (139) | York Water Co | Bank of America Merrill Lynch | 152 | | | | |
| (110) | York Water Co | Goldman Sachs | 133 | | | | |
| 340 | Yum! Brands Inc | Morgan Stanley | (2.567) | | | | |
| (2) | Zebra Technologies Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 16 | | | | |
| (30) | Zebra Technologies Corp 'A' | Morgan Stanley | 521 | | | | |
| (63) | Zentalis Pharmaceuticals Inc | Bank of America Merrill Lynch | 117 | | | | |
| (720) | Zentalis Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs | 1.339 | | | | |
| 1.330 | Zeta Global Holdings Corp 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 615 | | | | |
| 1.893 | Zeta Global Holdings Corp 'A' | Goldman Sachs | 801 | | | | |
| 260 | Ziff Davis Inc | Bank of America Merrill Lynch | (1.368) | | | | |
| 99 | Ziff Davis Inc | Goldman Sachs | (521) | | | | |
| 95 | Ziff Davis Inc | Morgan Stanley | (577) | | | | |
| 235 | Zillow Group Inc 'C' | Bank of America Merrill Lynch | (78) | | | | |
| 1.126 | Zillow Group Inc 'C' | Morgan Stanley | (135) | | | | |
| (122) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.449 | | | | |
| (42) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Goldman Sachs | 499 | | | | |
| (293) | Zimmer Biomet Holdings Inc | Morgan Stanley | 3.027 | | | | |
| 198 | Zions Bancorp NA | Bank of America Merrill Lynch | 792 | | | | |
| 700 | Zions Bancorp NA | Goldman Sachs | 2.800 | | | | |
| 219 | Zions Bancorp NA | Morgan Stanley | 53 | | | | |
| 878 | ZipRecruiter Inc 'A' | Bank of America Merrill Lynch | 527 | | | | |
| 1.431 | ZipRecruiter Inc 'A' | Goldman Sachs | 859 | | | | |
| 108 | Zoetis Inc | Morgan Stanley | (2.130) | | | | |
| (1.147) | ZoomInfo Technologies Inc | Bank of America Merrill Lynch | (3.688) | | | | |
| (2.058) | ZoomInfo Technologies Inc | Goldman Sachs | (6.616) | | | | |
| (500) | ZoomInfo Technologies Inc | Morgan Stanley | 133 | | | | |
| (160) | Zscaler Inc | Goldman Sachs | (1.713) | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD |
|---|------------|---------|------------|-----------------------------------|------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 25.619.641 | USD | 28.346.676 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (970.717) |
| USD | 1.352.064 | EUR | 1.239.593 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 27.494 |
| | | | | | | (943.223) |
| Auf GBP lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 262.054 | USD | 331.987 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (7.501) |
| USD | 13.723 | GBP | 10.975 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 133 |
| | | | | | | (7.368) |
| Auf SEK lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| SEK | 920.988 | USD | 86.155 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (1.366) |
| USD | 4.484 | SEK | 47.929 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 72 |
| | | | | | | (1.294) |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - USD 29.127.810) | | | | | | (951.885) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|----------------------------------|--------------|
| Staatsanleihen | 101,27 |
| Nicht zyklische Konsumgüter | 0,02 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 101,29 |
| Sonstige Nettoverbindlichkeiten | (1,29) |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV |
|--|---|------------------------|--------------------|---------------------------|---|------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | | | KURZFRISTIGE TITEL | | | |
| STAMMAKTIEN | | | | Australien | | | |
| 51.586 | Bermuda Hiscox Ltd | 610.778 | 0,31 | GBP 4.000.000 | Toyota Finance Australia Ltd 12/9/2023 (Zero Coupon) | 3.946.354 | 2,03 |
| | | 610.778 | 0,31 | | | 3.946.354 | 2,03 |
| 62.538 | Großbritannien Grainger Plc | 154.093 | 0,08 | Belgien | | | |
| 135.973 | Moonpig Group Plc | 182.884 | 0,09 | GBP 9.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp 12/6/2023 (Zero Coupon) | 8.987.789 | 4,61 |
| 178.157 | Taylor Wimpey Plc | 202.921 | 0,11 | | | 8.987.789 | 4,61 |
| | | 539.898 | 0,28 | Frankreich | | | |
| Gesamt Stammaktien | | 1.150.676 | 0,59 | GBP 7.000.000 | Antalis SA 9/6/2023 (Zero Coupon) | 6.993.122 | 3,59 |
| | | | | GBP 1.000.000 | BRED Banque Populaire 24/8/2023 (Zero Coupon) | 988.973 | 0,51 |
| | | | | GBP 7.000.000 | Managed and Enhanced Tap Magenta Funding ST SA 9/6/2023 (Zero Coupon) | 6.993.122 | 3,59 |
| | | | | GBP 3.000.000 | Satellite SASU 22/6/2023 (Zero Coupon) | 2.992.258 | 1,53 |
| | | | | | | 17.967.475 | 9,22 |
| | | | | Deutschland | | | |
| | | | | GBP 6.000.000 | Allianz SE 26/7/2023 (Zero Coupon) | 5.959.059 | 3,06 |
| | | | | | | 5.959.059 | 3,06 |
| | | | | Irland | | | |
| | | | | GBP 4.000.000 | Matchpoint Finance Plc 12/6/2023 (Zero Coupon) | 3.994.597 | 2,05 |
| | | | | GBP 4.000.000 | Matchpoint Finance Plc 11/8/2023 (Zero Coupon) | 3.963.098 | 2,04 |
| | | | | | | 7.957.695 | 4,09 |
| | | | | Luxemburg | | | |
| | | | | GBP 4.000.000 | Albion Capital Corp SA 20/6/2023 (Zero Coupon) | 3.990.622 | 2,05 |
| | | | | GBP 8.000.000 | Sunderland Receivables SA 12/6/2023 (Zero Coupon) | 7.989.146 | 4,10 |
| | | | | | | 11.979.768 | 6,15 |
| | | | | Niederlande | | | |
| GBP 8.000.000 | ABN AMRO Bank NV 1/6/2023 (Zero Coupon) | 7.997.986 | 4,11 | GBP 7.000.000 | PACCAR Financial Europe BV 12/6/2023 (Zero Coupon) | 6.990.535 | 3,59 |
| GBP 7.000.000 | ING Bank NV 6/11/2023 (Zero Coupon) | 6.842.245 | 3,51 | GBP 1.000.000 | PACCAR Financial Europe BV 14/6/2023 (Zero Coupon) | 998.402 | 0,51 |
| | | 14.840.231 | 7,62 | GBP 4.000.000 | Toyota Motor Finance 21/7/2023 (Zero Coupon) | 3.974.562 | 2,04 |
| | | | | | | 11.963.499 | 6,14 |
| | | | | Schweiz | | | |
| GBP 7.000.000 | Großbritannien DBS Bank LTD 30/8/2023 (Zero Coupon) | 6.915.020 | 3,55 | GBP 2.000.000 | UBS AG 5/6/2023 (Zero Coupon) | 1.999.077 | 1,03 |
| GBP 4.000.000 | Mizuho Bank Ltd 4,52% 12/6/2023 | 3.999.872 | 2,05 | GBP 5.000.000 | UBS AG 6/6/2023 (Zero Coupon) | 4.997.117 | 2,56 |
| GBP 4.000.000 | Nationwide Building Society FRN 5/6/2023 | 4.000.000 | 2,06 | | | 6.996.194 | 3,59 |
| | | 14.914.892 | 7,66 | Großbritannien | | | |
| GBP 4.000.000 | Vereinigte Staaten von Amerika Bank of America NA 7/8/2023 (Zero Coupon) | 3.963.967 | 2,03 | GBP 9.000.000 | National Westminster Bank Plc RegS 7/6/2023 (Zero Coupon) | 8.993.451 | 4,62 |
| | | 3.963.967 | 2,03 | | | 8.993.451 | 4,62 |
| Gesamt Einlagenzertifikate | | 69.544.590 | 35,70 | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Marktwert in GBP | In % des NAV |
|---|--|------------------------|--------------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | |
| GBP 1.000.000 | Mont Blanc Capital Corp 15/6/2023 (Zero Coupon) | 998.274 | 0,51 |
| GBP 8.000.000 | Nieuw Amsterdam Receivables Corp 12/6/2023 (Zero Coupon) | 7.989.193 | 4,10 |
| GBP 5.000.000 | Sheffield Receivables Co LLC 12/6/2023 (Zero Coupon) | 4.993.216 | 2,57 |
| | | 13.980.683 | 7,18 |
| Gesamt kurzfristige Titel | | 98.731.967 | 50,69 |
| Gesamt übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert oder auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden | | 169.427.233 | 86,98 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland | | | |
| 189.734 | BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) ⁻ | 18.963.412 | 9,74 |
| | | 18.963.412 | 9,74 |
| Gesamt Organismen für gemeinsame Anlagen | | 18.963.412 | 9,74 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | | 188.390.645 | 96,72 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | | 6.390.927 | 3,28 |
| Gesamt Netto-Fondsvermögen (GBP) | | 194.781.572 | 100,00 |
| ⁻ Für nähere Informationen zur Anlage in einen Fonds einer verbundenen Partei siehe Anmerkung 10. | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP | Bestand | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP | |
|-------------------------------------|--|------------------|---|--|--------------------------------|-------------|---|---------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | Großbritannien Fortsetzung | | | | |
| DIFFERENZKONTRAKTE | | | | 280.625 | Prudential Plc | JP Morgan | (308.687) | |
| Belgien | | | | 76.140 | Reckitt Benckiser Group Plc | HSBC | (135.529) | |
| (63.000) | Umicore SA | HSBC | 207.038 | 446.200 | RELX Plc | JP Morgan | 263.258 | |
| | | | 207.038 | 1.147.953 | Rentokil Initial Plc | JP Morgan | 50.510 | |
| Frankreich | | | | 14.215 | Rio Tinto Plc | JP Morgan | (21.878) | |
| (27.500) | Danone SA | HSBC | 117.889 | (1.944.479) | Rolls-Royce Holdings Plc | JP Morgan | 156.531 | |
| 30.850 | Safran SA | HSBC | 4.258 | (149.933) | Schroders Plc | JP Morgan | 21.196 | |
| | | | 122.147 | 4.814.239 | Serco Group Plc | JP Morgan | (365.882) | |
| Deutschland | | | | 335.172 | Shaftesbury Capital Plc (REIT) | JP Morgan | 18.770 | |
| (64.799) | Deutsche Post AG Reg | JP Morgan | (24.034) | 493.500 | Shell Plc | JP Morgan | (688.433) | |
| | | | (24.034) | (150.170) | Smiths Group Plc | HSBC | 70.580 | |
| Schweden | | | | 107.145 | Spectris Plc | HSBC | (90.002) | |
| (104.650) | H & M Hennes & Mauritz AB 'B' | HSBC | 72.020 | 102.705 | SSP Group Plc | HSBC | 13.352 | |
| | | | 72.020 | 512.475 | Standard Chartered Plc | JP Morgan | 164.612 | |
| Großbritannien | | | | 362.053 | Tate & Lyle Plc | HSBC | (93.799) | |
| 443.600 | 3i Group Plc | JP Morgan | 816.224 | 465.255 | Taylor Wimpey Plc | HSBC | (39.248) | |
| 90.244 | Anglo American Plc | HSBC | (183.195) | 1.461.225 | Tesco Plc | JP Morgan | (333.159) | |
| 94.300 | AstraZeneca Plc | JP Morgan | (224.434) | (26.116) | TUI AG (Right) | BNP Paribas | (7.548) | |
| 822.000 | Auto Trader Group Plc | HSBC | 60.828 | (33.472) | Unilever Plc | HSBC | 105.939 | |
| (524.130) | B&M European Value Retail SA | HSBC | (111.116) | 96.580 | Whitbread Plc | HSBC | 18.350 | |
| (86.000) | BAE Systems Plc | HSBC | 49.364 | 149.507 | WPP Plc | BNP Paribas | (42.759) | |
| (258.267) | Barratt Developments Plc | BNP Paribas | 102.532 | | | | 188.159 | |
| 261.915 | Better Capital PCC Ltd* | JP Morgan | (36.603) | Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| 258.365 | Bodycote Plc | HSBC | (73.634) | (34.100) | Conagra Brands Inc | HSBC | 69.587 | |
| 89.651 | BP Plc | BNP Paribas | (24.110) | (62.480) | Iron Mountain Inc (REIT) | HSBC | 121.404 | |
| 257.192 | BP Plc | HSBC | (86.149) | (4.900) | Marriott International Inc 'A' | HSBC | 43.660 | |
| 215.920 | British American Tobacco Plc | JP Morgan | (489.524) | (7.700) | WW Grainger Inc | JP Morgan | 176.405 | |
| (115.217) | Britvic Plc | JP Morgan | 53.000 | | | | 411.056 | |
| (114.745) | Bunzl Plc | JP Morgan | (28.686) | Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure – GBP 211.116.355) | | | | 976.386 |
| (150.955) | Coca-Cola HBC AG | HSBC | 146.426 | * Wertpapier unter Vorbehalt einer Anpassung an die beizulegenden Zeitwerte gemäß Anmerkung 2 (a). | | | | |
| 513.157 | Compass Group Plc | HSBC | 769.735 | | | | | |
| (95.881) | ConvaTec Group Plc | HSBC | 15.569 | | | | | |
| (13.270) | Croda International Plc | JP Morgan | 84.132 | | | | | |
| (43.855) | DCC Plc | HSBC | 54.530 | | | | | |
| (90.439) | Diageo Plc | Societe Generale | 235.594 | | | | | |
| (29.488) | Diploma Plc | JP Morgan | (83.873) | | | | | |
| 63.385 | Dowlais Group Plc | HSBC | 4.662 | | | | | |
| (335.553) | DS Smith Plc | HSBC | 27.851 | | | | | |
| (136.300) | Experian Plc | Societe Generale | (193.587) | | | | | |
| 800.600 | Glencore Plc | HSBC | (263.025) | | | | | |
| 424.502 | Grainger Plc | HSBC | (20.376) | | | | | |
| (75.755) | Greggs Plc | HSBC | 166.661 | | | | | |
| (53.917) | GSK Plc | JP Morgan | 50.358 | | | | | |
| (781.325) | Haleon Plc | JP Morgan | 144.545 | | | | | |
| 2.261.871 | Hays Plc | HSBC | (101.784) | | | | | |
| 65.979 | Hiscox Ltd | HSBC | 14.515 | | | | | |
| 1.096.590 | HSBC Holdings Plc | Societe Generale | (66.892) | | | | | |
| 10.563 | InterContinental Hotels Group Plc | HSBC | (19.647) | | | | | |
| (381.178) | International Consolidated Airlines Group SA | HSBC | 1.519 | | | | | |
| (2.223.660) | J Sainsbury Plc | JP Morgan | 409.153 | | | | | |
| (20.782) | Johnson Matthey Plc | HSBC | 44.520 | | | | | |
| (934.700) | Kingfisher Plc | BNP Paribas | 161.703 | | | | | |
| 6.440.371 | Lloyds Banking Group Plc | HSBC | (100.265) | | | | | |
| 30.526 | London Stock Exchange Group Plc | HSBC | 148.460 | | | | | |
| 513.995 | Melrose Industries Plc | HSBC | 129.063 | | | | | |
| 152.849 | Moonpig Group Plc | HSBC | 1.223 | | | | | |
| 555.140 | NatWest Group Plc | BNP Paribas | (23.316) | | | | | |
| (692.536) | Ninety One Plc | BNP Paribas | 73.409 | | | | | |
| 820.000 | Pearson Plc | HSBC | (191.486) | | | | | |
| (262.438) | Pets at Home Group Plc | JP Morgan | 33.385 | | | | | |
| 289.450 | Phoenix Group Holdings Plc | HSBC | (45.274) | | | | | |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund Fortsetzung

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023

| Anzahl der Kontrakte | Vertragswährung | Kontrakte/Bezeichnung | Verfallsdatum | Zugrunde liegendes Bruttoengagement GBP | Nicht realisierter Nettogewinn GBP |
|-------------------------------------|-----------------|----------------------------------|---------------|---|------------------------------------|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | |
| TERMINKONTRAKTE | | | | | |
| (765) | GBP | FTSE 100 Index Futures June 2023 | Juni 2023 | 57.275.550 | 566.272 |
| Gesamt | | | | | 566.272 |

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Gegenpartei | Fälligkeit | Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) GBP |
|--|----------------|---------|-------------|-----------------------------------|------------|---|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| OFFENE DEVISENTERMINGESCHÄFTE | | | | | | |
| Auf CHF lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| CHF | 5.466 | GBP | 4.872 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (28) |
| GBP | 3 | CHF | 3 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | — |
| | | | | | | (28) |
| Auf EUR lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| EUR | 11.254.249 | GBP | 9.828.210 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (116.242) |
| GBP | 2.904.004 | EUR | 3.341.143 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 20.730 |
| | | | | | | (95.512) |
| Auf JPY lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| JPY | 30.933.610.057 | GBP | 181.636.395 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (3.052.351) |
| | | | | | | (3.052.351) |
| Auf USD lautende Hedged Anteilklasse | | | | | | |
| GBP | 131.499 | USD | 166.511 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | (2.975) |
| USD | 11.047.922 | GBP | 8.719.110 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2023 | 203.150 |
| | | | | | | 200.175 |
| Gesamtsumme (zugrunde liegendes Brutto-Exposure - GBP 200.240.864) | | | | | | (2.947.716) |

Aufgliederung nach Branchen zum 31. Mai 2023

| | In % des NAV |
|-----------------------------------|--------------|
| Finanzen | 78,61 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 9,74 |
| Zyklische Konsumgüter | 4,18 |
| Industrie | 4,10 |
| Kommunikation | 0,09 |
| Wertpapiervermögen zum Marktwert | 96,72 |
| Sonstiges Netto-Fondsvermögen | 3,28 |
| | 100,00 |

Die Anmerkungen auf den Seiten 573 bis 603 sind wesentlicher Bestandteil dieses Berichts.

Anmerkungen zum Jahresabschluss

1. Organisation

BlackRock Strategic Funds (die „Gesellschaft“) ist eine als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (*Société d'Investissement à Capital Variable*) nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg errichtete Aktiengesellschaft (*Société Anonyme*). Die Gesellschaft wurde von der luxemburgischen Aufsichtsbehörde, der *Commission de Surveillance du Secteur Financier* („CSSF“), als OGAW gemäß den Bestimmungen von Teil I des Gesetzes von 2010 zugelassen und unterliegt deren Aufsicht gemäß diesem Gesetz.

Zu ihrer Verwaltungsgesellschaft hat die Gesellschaft BlackRock (Luxembourg) S.A. bestellt.

Zum 31. Mai 2023 gehörten 30 Fonds (einzeln „ein Fonds“, zusammen „die Fonds“) zur Fondspalette der Gesellschaft. Die Gesellschaft hat die Struktur eines Umbrellafonds und umfasst mehrere Fonds mit getrennter Haftung. Jeder Fonds haftet getrennt von den anderen Fonds und die Gesellschaft haftet nicht als Ganzes gegenüber Dritten für die Verbindlichkeiten einzelner Fonds. Jeder Fonds setzt sich aus einem getrennten Anlageportfolio zusammen, das gemäß den Anlagezielen jedes Fonds verwaltet und investiert wird. Jeder Fonds bildet ein Sondervermögen und besteht aus getrennten Anteilen, die, wie in Anhang I dargestellt, in Anteilklassen unterteilt sind.

Die Anteilklassen haben gleiche Rechte in der Gesellschaft, zeichnen sich jedoch durch unterschiedliche Eigenschaften und Gebührenstrukturen aus. Nähere Informationen hierzu können Sie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft nachlesen.

Auflegung von Anteilklassen

Anteilklassen, die während des Geschäftsjahres aufgelegt wurden, werden in Anhang I aufgeführt.

Bedeutende Ereignisse des Berichtsjahres

- ▶ Ein neuer Prospekt wurde am 20. Juni 2022 veröffentlicht.
- ▶ Mit Wirkung zum 20. Juni 2022 wurde der BlackRock Fixed Income Strategies Fund in BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund umbenannt.
- ▶ Mit Wirkung zum 31. Juli 2022 schied Barry O'Dwyer aus dem Verwaltungsrat der Gesellschaft aus.
- ▶ Ein neuer Prospekt wurde am 18. August 2022 veröffentlicht.
- ▶ Mit Wirkung zum 18. August 2022 wurde der BlackRock ESG Euro Bond Fund in BlackRock Sustainable Euro Bond Fund umbenannt.
- ▶ Mit Wirkung zum 18. August 2022 wurde der BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund in BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund umbenannt.
- ▶ Mit Wirkung zum 18. August 2022 wurde der BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund in BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund umbenannt.

- ▶ Mit Wirkung zum 18. August 2022 wurde der BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund in BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund umbenannt.
- ▶ Mit Wirkung zum 6. Oktober 2022 wurde Bettina Mazzocchi zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft ernannt.
- ▶ Am 29. Dezember 2022 wurde ein neuer Prospekt herausgegeben.
- ▶ Mit Wirkung zum 3. März 2023 wurde Vasiliki Pachatouridi in den Verwaltungsrat der Gesellschaft berufen.

2. Zusammenfassung wichtiger Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden

Der vorliegende Abschluss wurde nach Maßgabe der in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätze und der geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen der Luxemburger Behörden zur Erstellung von Abschlüssen Luxemburger OGAW und unter Beachtung der folgenden wichtigen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden erstellt:

(a) Bewertung von Anlagen, sonstigen Vermögenswerten und sonstigen Verbindlichkeiten

Die Anlagen, sonstigen Vermögenswerte und sonstigen Verbindlichkeiten der Gesellschaft werden wie folgt bewertet:

- ▶ Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden basierend auf dem am Bewertungstag zuletzt verfügbaren Kurs bewertet. Für Wertpapiere, die nach dem Bewertungszeitpunkt an Märkten gehandelt werden, können die zuletzt bekannten Preise zu diesem Zeitpunkt oder einem solchen anderen Zeitpunkt verwendet werden. Werden diese Wertpapiere oder sonstige Vermögenswerte an mehreren Börsen oder geregelten Märkten notiert bzw. gehandelt, steht es dem Verwaltungsrat frei, nach seinem Ermessen einen dieser Börsenplätze oder geregelten Märkte auszuwählen und zur Bewertung heranzuziehen. Abweichungen im Wert der Wertpapiere können beispielsweise auftreten, wenn die zugrunde liegenden Märkte zum Zeitpunkt der Nettoinventarwertberechnung bestimmter Fonds geschlossen sind oder wenn Regierungen Steuern oder Transaktionsgebühren auf Anlagen im Ausland erheben. Für diesen Fall hat der Verwaltungsrat Verfahren zur Bestimmung des Marktwerts eingeführt, um den angemessenen Wert dieser Anlagen zu schätzen. Solche Wertpapiere und Derivate sind mit ihrem durch die zuständigen Personen (dem Verwaltungsrat) ermittelten wahrscheinlichen Realisationswert zu bewerten. Wegen der mit Unsicherheiten behafteten Bewertung zum Marktwert können diese Schätzwerte erheblich von den Werten, die bei Vorhandensein eines aktiven Marktes für diese Wertpapiere verwendet worden wären, sowie von den Werten abweichen, die möglicherweise letztlich realisierbar gewesen wären;

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

- ▶ bei nicht notierten Wertpapieren oder Wertpapieren, die weder an einer Börse noch an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (einschließlich Wertpapiere geschlossener Investmentfonds), sowie bei an anderen Märkten notierten oder nicht notierten Wertpapieren, für die kein Bewertungskurs verfügbar ist, oder bei Wertpapieren, deren notierter Kurs nach Meinung des Verwaltungsrats nicht den fairen Marktwert widerspiegelt, wird der Wert vom Verwaltungsrat nach Treu und Glauben basierend auf dem zu erwartenden Veräußerungs- bzw. Kaufpreis bestimmt;
- ▶ Zum 31. Mai 2023 wird die angepasste Bewertung bestimmter Wertpapiere und/oder Derivate in folgender Tabelle veröffentlicht:

| Fonds | Währung | Beizulegender Zeitwert | In % des NIW |
|--|---------|------------------------|--------------|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | 196.671 | 0,03 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | (48.512) | (0,09) |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 8.784 | 0,00 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 734.256 | 0,02 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽²⁾ | EUR | 7.305 | 0,00 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund ⁽¹⁾ | USD | 3 | 0,00 |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | (2.627) | (0,01) |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | GBP | (36.603) | (0,02) |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

- ▶ wenn mit den vorstehend dargestellten Methoden kein bestimmter Wert feststellbar ist oder wenn der Verwaltungsrat der Auffassung ist, dass eine andere Bewertungsmethode den beizulegenden Zeitwert des betreffenden Wertpapiers oder sonstigen Vermögenswertes für die verfolgten Zwecke besser erfasst, wird für die Bewertung des Wertpapiers oder eines sonstigen Vermögenswertes die Methode angewandt, welche der Verwaltungsrat im eigenen Ermessen bestimmt. Abweichungen beim Wert der Wertpapiere können beispielsweise auftreten, wenn die zugrunde liegenden Märkte zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts (NIW) bestimmter Fonds geschlossen sind. In diesen Fällen kann der Verwaltungsrat bestimmte Grenzen festlegen, bei deren Überschreitung eine Anpassung des Nettoinventarwerts durch Anwendung einer speziellen Indexanpassung erfolgt. Wenn darüber hinaus bestimmte Länder Steuern oder Transaktionsgebühren auf ausländische Anlagen erheben, kann der Verwaltungsrat den Nettoinventarwert anpassen, um solche Gebühren entsprechend zu berücksichtigen.
- ▶ Zum 31. Mai 2023 hielten der BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (eingestellt am 6. Mai 2022), der BlackRock Latin American Opportunities Fund (eingestellt am 8. März 2019) und der BlackRock Total Advantage Fund

(eingestellt am 24. August 2021) offene illiquide Positionen, die zusammen weniger als 1,00% des Nettoinventarwerts der Fonds zum letzten Bewertungszeitpunkt vor dem Auflösungsdatum des Fonds ausmachten. Wenn die illiquiden Wertpapiere zu einem späteren Zeitpunkt veräußert werden oder ihr Wert realisiert wird, erfolgt die Ausschüttung an die Anteilinhaber entsprechend ihrer anteilmäßigen Beteiligung am Fonds zum Auflösungsdatum.

- ▶ Anlagen in offene Organismen für gemeinsame Anlagen werden auf Grundlage des letzten verfügbaren NIW der Anteile dieser Organismen für gemeinsame Anlagen bewertet;
- ▶ bestimmte Fonds können entscheiden, Anteilklassen mit unterschiedlichen Bewertungspunkten aufzulegen, die als „Snap“ und „Close“ bezeichnet werden. Der Bewertungspunkt „Snap“ nimmt einen Wert zu einem anderen Zeitpunkt als der Marktschließung, der Bewertungspunkt „Close“ nimmt den Wert auf Grundlage der Marktschlusskurse. Folglich werden die Nettoinventarwerte und die Wertentwicklung pro Anteil einer solchen Anteilklasse aufgrund der Anwendung unterschiedlicher Bewertungspunkte voraussichtlich voneinander abweichen. Im Zeitraum vom 1. Juni 2022 bis 7. Februar 2023 nahmen die auf AUD lautenden thesaurierenden abgesicherten Anteile der Klasse X des BlackRock Style Advantage Fund einen dualen Bewertungspunkt an. Zum 7. Februar 2023 betragen das Gesamt Netto-Fondsvermögen (Total Net Assets, TNA) und der Nettoinventarwert pro Anteil (NIW pro Anteil) der auf AUD lautenden thesaurierenden abgesicherten Anteile der Klasse X zum Snap-Bewertungspunkt 45.976.677 AUD bzw. 101,38 AUD. Zum Close-Bewertungszeitpunkt betragen das TNA und der NIW pro Anteil 45.983.335 AUD bzw. 101,4 AUD. Dies hat zu einer Abweichung zwischen den TNAs des Fonds geführt. Die prozentuale Abweichung zwischen den Snap- und Close-TNAs des Fonds betrug 0,01%. Mit Wirkung zum 8. Februar 2023 wurde die Anteilsklasse in einen Snap-Bewertungszeitpunkt umgewandelt. Zum 31. Mai 2023 und seit dem 8. Februar 2023 ist die auf AUD lautende thesaurierende abgesicherte Klasse X des BlackRock Style Advantage Fund auf die anderen Anteilklassen des Fonds abgestimmt;
- ▶ Wertpapierleihe: Gemäß den Anweisungen des Beauftragten für Wertpapierleihgeschäfte werden Wertpapiere an einen Börsenmakler geliefert und weiter als Teil der Portfolios der Fonds behandelt und entsprechend bewertet;
- ▶ liquide Mittel wie Termingelder und Geldmarktinstrumente werden zu ihren fortgeführten Anschaffungskosten bewertet, was ihrem beizulegenden Zeitwert nahekommt;
- ▶ Bargeld und sonstige Vermögenswerte werden zu ihrem Nennwert bewertet;
- ▶ Vermögenswerte, zu denen insbesondere Barverbindlichkeiten gegenüber der Bank, Forderungen aus Zinsen und Dividenden, Forderungen aus verkauften Anlagen und Forderungen aus gezeichneten Fondsanteilen gehören,

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

werden zu ihrem Nennwert bewertet, es sei denn, die Erzielung eines solchen Nennwerts ist unwahrscheinlich;

- Verbindlichkeiten, die insbesondere Verbindlichkeiten aus Zinsen und Dividenden, Verbindlichkeiten aus Ertragsausschüttungen, Verbindlichkeiten aus erworbenem Anlagevermögen und Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Fondsanteilen umfassen, werden zu ihrem Nennwert bewertet.

(b) Realisierte Nettogewinne und -verluste aus Anlagen

Realisierte Nettogewinne und -verluste aus dem Verkauf von Anlagen werden nach der Durchschnittskostenmethode ermittelt.

(c) Erträge/Aufwendungen aus/für Anlagen, Geldkonten und Finanzderivaten

Die erzielten Erträge aus Anlagen werden von der Gesellschaft wie folgt verbucht:

- Zinserträge/Zinsaufwendungen laufen täglich auf und umfassen die lineare Abschreibung von Aufgeldern und die lineare Zuschreibung von Disagios;
- Bankzinsen und Zinserträge aus Festzins- sowie Geldmarkteinlagen werden periodengerecht abgegrenzt;
- Dividendenerträge werden zum Datum der Notierung der Ex-Dividende;
- Erträge aus Wertpapierleihgeschäften werden täglich periodengerecht erfasst;
- Aufwendungen aufgrund von Negativrenditen von Finanzvermögenswerten im Zusammenhang mit Zinsen aus einem negativen Zinssatz auf gehaltene Vermögenswerte werden täglich zugeschrieben und über die Laufzeit des zugrunde liegenden Instruments in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen;
- Wird bei einer Anleihe ein Zahlungsausfall festgestellt, wird die Zinsabgrenzung auf das ausgefallene Wertpapier eingestellt. Bei Bestätigung des Zahlungsausfalls seitens einschlägiger Stellen wird der Forderungsbetrag abgeschrieben;
- der Zinssatz ewiger Anleihen im Portfolio der Anlagen, offenbart unter der Beschreibung, ist der Zinssatz, anwendbar zum Ende des Zeitraums und dient nur zur Information, weil diese Anleihen variable Zinssätze besitzen.

(d) Derivative Finanzinstrumente

Im Laufe des Berichtsjahres haben die Fonds eine Reihe von Devisentermingeschäften und Terminkontrakten abgeschlossen. Offene Devisentermingeschäfte und Futures-Kontrakte werden zum fairen Marktwert ihrer Glattstellung am Bewertungstag bewertet. Überschüsse/Fehlbeträge aus diesen sowie aus noch nicht abgerechneten Kontrakten werden den nicht realisierten

Gewinnen/Verlusten zugerechnet und unter „Vermögenswerte“ bzw. „Verbindlichkeiten“ in der Zusammensetzung des Nettofondsvermögens aufgeführt. Die Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses (oder -verlusts) und die realisierten Nettogewinne oder -verluste aus der Ausführung oder dem Abschluss von Devisentermingeschäften und Terminkontrakten werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen.

Die Fonds können gedeckte Kauf- und Verkaufsoptionen oder Swaptionen verkaufen sowie Kauf- und Verkaufsoptionen oder Swaptionen kaufen. Bei Verkauf und/oder Kauf einer Option oder Swaption durch den Fonds wird ein Betrag in Höhe der von den Fonds erhaltenen oder gezahlten Prämie als Vermögenswert oder Verbindlichkeit ausgewiesen. Die Verbindlichkeit einer verkauften Option oder Swaption und der Vermögenswert einer gekauften Option oder Swaption werden nachfolgend mit dem aktuellen Marktpreis angesetzt, der den Zeitwert der Option oder Swaption widerspiegelt. Bei Verkauf oder Kauf eines Wertpapiers durch Ausüben einer Option oder Swaption wird die erhaltene (oder gezahlte) Prämie vom Basispreis des verkauften oder gekauften Wertpapiers abgezogen (oder zum Basispreis addiert). Bei Verfall einer Option oder Swaption (oder wenn die Fonds ein Glattstellungsgeschäft abschließen) realisieren die Fonds einen Gewinn oder Verlust aus der Option oder Swaption in Höhe der erhaltenen oder gezahlten Prämie (oder einen Gewinn oder Verlust in der Höhe, in der die Kosten für die Glattstellungsgeschäfte die gezahlte oder erhaltene Prämie übersteigen). Bei Optionen auf Terminkontrakte zahlen die Fonds keine Prämie im Voraus. Die Fonds hinterlegen Marginzahlungen wie bei einem Futures-Kontrakt, und die Optionsprämie wird täglich zum Marktpreis bewertet. Die zum Marktwert gekauften Optionen oder Swaptionen und die zum Marktwert verkauften Optionen oder Swaptionen sind in den Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten (je nachdem, was zutrifft) in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens enthalten. Die Nettoveränderung des nicht realisierten Netto-Wertzuwachses oder -verlusts und der bei Ablauf oder bei Glattstellungstransaktionen von Optionen oder Swaptions realisierten Gewinne oder Verluste sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen.

Die Fonds sind im Laufe des Jahres Differenzkontrakte (CFDs) eingegangen. Differenzkontrakte ermöglichen es den Anlegern, synthetische Long- bzw. Short-Positionen mit einer variablen Sicherheitsleistung einzunehmen. Im Unterschied zu Aktien haftet der Käufer im Falle von Differenzkontrakten möglicherweise für einen erheblich höheren Betrag als für den als Sicherheitsleistung gezahlten Betrag.

CFD-Positionen werden vorbehaltlich einer täglichen Finanzierungsgebühr eingegangen, die zu einem im Vorfeld vereinbarten Zinssatz oberhalb oder unterhalb des geltenden Referenzwerts berechnet wird. Die damit verbundenen Zinserträge oder -aufwendungen sammeln sich täglich an und werden als Differenzkontrakte in einer Nettoposition in der „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen“ ausgewiesen. Hieraus resultierende Zinserträge oder -aufwendungen werden in einer Nettoposition als „Zins- und Dividendenforderungen“ bzw. als „Zins- und Dividendenverbindlichkeiten“ in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

CFDs-Positionen unterliegen Dividendenquittungen oder -zahlungen, wenn eine Position an dem Tag, an dem eine Dividende erklärt wurde, gehalten wird. Hieraus resultierende Zinserträge oder -aufwendungen laufen zum Datum der Notierung der Ex-Dividende auf und werden nach Abzug von Quellensteuern als CFD-Dividenden abzüglich Quellensteuer in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen. Hieraus resultierende Einkommenserträge oder -aufwendungen werden in einer Nettoposition als „Zins- und Dividendenforderungen“ bzw. als „Zins- und Dividendenverbindlichkeiten“ in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen.

Der beizulegende Marktwert von Differenzkontrakten wird anhand des Handelspreises an der Börse ermittelt, an der die zugrunde liegenden Wertpapiere oder sonstigen Vermögenswerte gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind. Für zugrunde liegende Wertpapiere, die an Börsen gehandelt werden, die erst nach dem Bewertungszeitpunkt schließen, werden die zu diesem oder einem anderen Zeitpunkt zuletzt bekannten Preise zu Bewertungszwecken herangezogen.

Die nicht realisierte Nettoaufwertung und die nicht realisierte Nettoabwertung für Differenzkontrakte sind in Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten (je nachdem, was zutrifft) in der Aufstellung des Nettofondsvermögens enthalten.

Eine etwaige Änderung des Marktwertes wird als nicht realisierter Nettowertzuwachs oder -verlust in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. Realisierte Nettogewinne oder Verluste bei Zurücksetzung oder Kündigung von Differenzkontrakten werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens ausgewiesen.

Realisierte Nettogewinne und -verluste aus dem Verkauf von CFDs wurden auf der Kostenbasis nach der „First In First Out“-Kostenmethode („FIFO“) ermittelt.

Die offenen CFD-Transaktionen der Fonds zum 31. Mai 2023 werden unter den Posten „Forderungen aus verkauftem Anlagevermögen“ und „Verbindlichkeiten aus erworbenem Anlagevermögen“ in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. CFDs werden in der Vermögensaufstellung gesondert aufgeführt.

Die Fonds können Swap-Transaktionen („Swaps“) eingehen, in denen die Fonds und ein Kontrahent vereinbaren, regelmäßige Nettozahlungen zu tauschen, die sich auf einen bestimmten Nominalbetrag beziehen. Swap-Transaktionen werden am OTC-Markt privat ausgehandelt und können als bilateraler Vertrag („OTC-Swaps“) oder zentral abgewickelt („zentral abgewickelte Swaps“) eingegangen werden. Diese regelmäßig getätigten oder erhaltenen Zahlungen werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens als Nettogewinne bzw. -verluste aufgeführt. Swaps werden auf Basis von Kurse bewertet, die täglich beim Preisberechnungs-Service der Fonds, zentralen Clearing-Stellen oder Börsenmaklern eingehen und mittels täglicher Swap-Kurven und -Modellen hergeleitet werden, in die zahlreiche

Marktfaktoren wie abgezinste Cashflows, Handelsgeschäfte und Werte der zugrunde liegenden Referenzinstrumente einfließen. Bei einem zentral abgewickelten Swap erfolgt unmittelbar nach der Ausführung der Swap-Vereinbarung eine Novation der Swap-Vereinbarung auf eine zentrale Clearing-Stelle und der Fonds interagiert über einen Broker mit dem Clearing-Kontrahenten. Beim Eingehen eines zentral abgewickelten Swaps muss der Fonds beim Börsenmakler eine Sicherheitenmarge in Form von Barmitteln oder bestimmten anrechnungsfähigen Wertpapieren hinterlegen. Der Betrag variiert je nach Größe und Risikoprofil des entsprechenden Swaps. Etwaige bei Eingehen eines Swapvertrags getätigte oder erhaltene Vorauszahlungen werden als Teil der im Rahmen des Swaps realisierten Nettogewinne oder -verluste behandelt. Die tägliche Neubewertung zentral abgewickelter Swaps wird in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten als Forderung oder Verbindlichkeit für die Variation Margin (Nachschussmarge) in der Cash-at-Bank-Position oder in der Cash-owned-to-Bank-Position der Zusammenfassung des Nettofondsvermögens erfasst, bis der zentral abgewickelte Swap beendet und damit ein realisierter Nettogewinn oder -verlust erfasst wird. Die Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses oder -verlusts auf Swap-Transaktionen ist in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. Hieraus resultierende Zinsforderungen oder -aufwendungen auf Swaps werden in einer Nettoposition als erwirtschaftete Zinsen oder Dividenden oder zahlbare Zinsen und Dividenden in der Zusammenfassung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. Die offenen Swap-Transaktionen der Fonds zum 31. Mai 2023 sind in den Posten „Forderungen aus verkauftem Anlagevermögen“ und „Verbindlichkeiten aus erworbenem Anlagevermögen“ in der Aufstellung des Nettofondsvermögens enthalten. Swaps werden in der Vermögensaufstellung gesondert aufgeführt.

Realisierte Nettogewinne und -verluste aus dem Verkauf von Swaps wurden auf der Kostenbasis nach der „First In First Out“-Kostenmethode („FIFO“) ermittelt.

Fonds können Wertpapierkontrakte der Kategorie „To Be Announced“ („TBA“ – hierbei werden die endgültigen Emissionsmodalitäten noch bekannt gegeben) erwerben. Hierbei handelt es sich um ein handelsübliches Verfahren am Markt für hypothekenbesicherte Wertpapiere, bei dem ein Kontrakt gekauft wird, der dem Käufer Anspruch auf ein Wertpapier aus einem Hypotheken-Pool zu einem festgelegten Preis und einem zuvor festgelegten späteren Zeitpunkt verleiht. Zum Zeitpunkt des Erwerbs sind die wesentlichen Merkmale, nicht jedoch das zu erwerbende Wertpapier bekannt. Während der Preis zum Zeitpunkt des Erwerbs feststeht, ist der Nennwert des Wertpapiers nicht bekannt. Da ein TBA nicht zum Zeitpunkt des Erwerbs abgewickelt wird, kann dies gehebelte Positionen in einem Fonds mit sich bringen. Mit dem Kauf eines TBA ist ein Verlustrisiko verbunden, sofern der Wert des zu erwerbenden Wertpapiers vor dem Abwicklungstermin fällt. Risiken im Zusammenhang mit diesen Kontrakten ergeben sich auch aus der Möglichkeit, dass die Kontrahenten die vertraglichen Bedingungen des Kontrakts nicht erfüllen können. TBAs werden am Ende der Vermögensaufstellung gesondert aufgeführt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

Die Fonds können eine Verpflichtung vor deren Erfüllung verkaufen, falls dies für angebracht erachtet wird. Erlöse aus dem Verkauf von TBA-Wertpapieren werden erst zum vertraglich vereinbarten Abwicklungstermin vereinnahmt. Solange eine TBA-Verkaufsposition noch nicht geschlossen ist, wird eine solche Transaktion durch vergleichbare lieferbare Wertpapiere oder eine kompensierende TBA-Kaufposition gedeckt (die an oder vor dem Abwicklungstermin zur Belieferung ansteht).

Wird eine TBA-Verkaufsposition durch den Erwerb einer kompensatorischen Kaufposition geschlossen, so hat der Fonds einen Gewinn oder Verlust hieraus realisiert, ungeachtet eines möglichen nicht realisierten Gewinns oder Verlusts aus dem zugrunde liegenden Wertpapier. Liefert der Fonds im Rahmen einer solchen Verpflichtung Wertpapiere, so realisiert der Fonds einen Gewinn oder Verlust aus dem Verkauf der Wertpapiere, basierend auf dem Stückpreis, der zum Zeitpunkt des Abschlusses einer solchen Verpflichtung festgesetzt wurde.

Die offenen TBA-Transaktionen der Fonds zum 31. Mai 2023 sind in den Posten „Forderungen aus verkauftem Anlagevermögen“ und „Verbindlichkeiten aus erworbenem Anlagevermögen“ in der Aufstellung des Nettofondsvermögens enthalten.

Die Marktwerte der TBAs sind in der Aufstellung des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen. Die Nettoveränderung des nicht realisierten Nettowertzuwachses oder -verlusts und der beim Verkauf der TBAs realisierten Gewinne oder Verluste sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen.

Realisierte Nettogewinne und -verluste aus dem Verkauf von TBA wurden auf der Kostenbasis nach der „First In First Out“-Kostenmethode („FIFO“) ermittelt.

(e) Fremdwährungen

Die Kosten für den Erwerb von Anlagen, die auf eine andere Währung als die Währung des jeweiligen Fonds lauten, wurden zu dem zum Erwerbszeitpunkt geltenden Wechselkurs umgerechnet. Anlagen und sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die Nennwährung des jeweiligen Fonds lauten, wurden zu dem am Bewertungszeitpunkt in Luxemburg am 31. Mai 2023 geltenden Wechselkurs umgerechnet. Die Netto-Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses oder Wertverlusts sowie die realisierten Gewinne oder Verluste aus der Veräußerung oder Abwicklung anderer Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten in Währungen, auf die der jeweilige Fonds nicht lautet, sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Nennwährung des jeweiligen Fonds lauten, wurden zu dem zum Transaktionstag geltenden Wechselkurs umgerechnet.

Unterschiedliche Wechselkurse ergeben sich aus der Preismatrix und unterschiedlichen Bewertungspunkten zwischen den verschiedenen Portfolios. In der nachstehenden Tabelle werden die Wechselkurse von 17:00 Uhr MEZ am 31. Mai 2023 für

den BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund und die Wechselkurse von 16:00 Uhr MEZ am 31. Mai 2023 für alle anderen Fonds dargestellt.

Anlagen und sonstige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten aller Fonds, die auf andere Währungen als die Nennwährung des jeweiligen Fonds am jeweiligen Bewertungszeitpunkt des Fonds lauten, wurden zum 31. Mai 2023 mit folgenden Wechselkursen umgerechnet:

| WÄHRUNG | Alle Fonds (außer der BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund) | | | BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund |
|---------|--|--------|--------|---|
| | EUR | GBP | USD | EUR |
| AED | 0,2550 | 0,2199 | 0,2723 | 0,2554 |
| ARS | 0,0019 | 0,0017 | 0,0021 | 0,0019 |
| AUD | 0,6068 | 0,5234 | 0,6479 | 0,6070 |
| BRL | 0,1845 | 0,1592 | 0,1970 | 0,1831 |
| CAD | 0,6876 | 0,5931 | 0,7342 | 0,6901 |
| CHF | 1,0262 | 0,8851 | 1,0957 | 1,0261 |
| CLP | 0,0012 | 0,0010 | 0,0012 | 0,0012 |
| CNH | 0,1314 | 0,1133 | 0,1403 | 0,1316 |
| CNY | 0,1314 | 0,1133 | 0,1403 | 0,1316 |
| COP | 0,0002 | 0,0002 | 0,0002 | 0,0002 |
| CZK | 0,0421 | 0,0363 | 0,0449 | 0,0421 |
| DKK | 0,1343 | 0,1158 | 0,1434 | 0,1343 |
| EGP | 0,0303 | 0,0261 | 0,0324 | 0,0304 |
| EUR | 1,0000 | 0,8625 | 1,0677 | 1,0000 |
| GBP | 1,1594 | 1,0000 | 1,2379 | 1,1626 |
| HKD | 0,1196 | 0,1031 | 0,1276 | 0,1198 |
| HUF | 0,0027 | 0,0023 | 0,0029 | 0,0027 |
| IDR | 0,0001 | 0,0001 | 0,0001 | 0,0001 |
| ILS | 0,2516 | 0,2170 | 0,2686 | 0,2511 |
| INR | 0,0113 | 0,0098 | 0,0121 | 0,0113 |
| JPY | 0,0067 | 0,0058 | 0,0071 | 0,0067 |
| KRW | 0,0007 | 0,0006 | 0,0008 | 0,0007 |
| LKR | 0,0032 | 0,0028 | 0,0034 | 0,0032 |
| MXN | 0,0530 | 0,0457 | 0,0566 | 0,0528 |
| MYR | 0,2029 | 0,1750 | 0,2167 | 0,2032 |
| NGN | 0,0014 | 0,0012 | 0,0015 | 0,0014 |
| NOK | 0,0839 | 0,0724 | 0,0896 | 0,0842 |
| NZD | 0,5616 | 0,4844 | 0,5997 | 0,5622 |
| PEN | 0,2547 | 0,2197 | 0,2720 | 0,2548 |
| PHP | 0,0167 | 0,0144 | 0,0178 | 0,0167 |
| PLN | 0,2204 | 0,1901 | 0,2354 | 0,2205 |
| RON | 0,2012 | 0,1736 | 0,2148 | 0,2013 |
| RUB | 0,0115 | 0,0100 | 0,0123 | 0,0115 |
| SAR | 0,2497 | 0,2154 | 0,2666 | 0,2501 |
| SEK | 0,0862 | 0,0743 | 0,0920 | 0,0862 |
| SGD | 0,6918 | 0,5967 | 0,7387 | 0,6923 |
| THB | 0,0269 | 0,0232 | 0,0287 | 0,0270 |
| TRY | 0,0452 | 0,0390 | 0,0483 | 0,0453 |
| TWD | 0,0305 | 0,0263 | 0,0325 | 0,0305 |
| UAH | 0,0254 | 0,0219 | 0,0271 | 0,0254 |
| USD | 0,9365 | 0,8078 | 1,0000 | 0,9380 |
| ZAR | 0,0476 | 0,0410 | 0,0508 | 0,0473 |
| ZMW | 0,0481 | 0,0415 | 0,0513 | 0,0481 |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

(f) Konsolidierter Jahresabschluss

Die Konten der einzelnen Fonds werden in der Basiswährung der Fonds angegeben. Die konsolidierten Zahlen der Gesellschaft werden in USD ausgewiesen und beinhalten – ggf. umgerechnet – den Gesamtabschluss der verschiedenen Fonds. Für die Umrechnung des Netto-Fondsvermögens aller auf EUR lautender Teilfonds bis auf den BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund wurde der zum Bewertungszeitpunkt aller Fonds am 31. Mai 2023 in Luxemburg geltende Wechselkurs herangezogen:

| | EUR |
|-----|--------|
| USD | 0,9365 |

Für den BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund wurde der zum Bewertungszeitpunkt des Fonds am 31. Mai 2023 in Luxemburg geltende Wechselkurs herangezogen:

| | EUR |
|-----|--------|
| USD | 0,9380 |

Für den BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund und BlackRock UK Equity Absolute Return Fund wurde der zum Bewertungszeitpunkt des Fonds am 31. Mai 2023 in Luxemburg geltende Wechselkurs verwendet:

| | GBP |
|-----|--------|
| USD | 0,8078 |

Für die Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen gilt für die Umrechnung der folgende durchschnittliche Wechselkurs, der über das Jahr für alle auf Euro lautenden Fonds mit Ausnahme des BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund berechnet wurde:

| | EUR |
|-----|--------|
| USD | 0,9568 |

Für den BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund wird der folgende durchschnittliche über das Jahr berechnete Wechselkurs verwendet:

| | EUR |
|-----|--------|
| USD | 0,9568 |

Für den BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund und den BlackRock UK Equity Absolute Return Fund werden der folgende durchschnittliche über das Jahr berechnete Wechselkurs verwendet:

| | GBP |
|-----|--------|
| USD | 0,8320 |

Die Berechnung der konsolidierten Angaben in der „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen“ erfolgte unter Verwendung der durchschnittlichen Wechselkurse im Laufe des Jahres. Die daraus resultierende Wechselkursberichtigung

von (117.153.757) USD berücksichtigt die Wechselkursschwankungen zwischen dem 1. Juni 2022 und dem 31. Mai 2023. Hierbei handelt es sich um einen fiktiven Betrag, der keinerlei Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der einzelnen Fonds hat.

(g) Ertragsausgleich

Die Gesellschaft nimmt Maßnahmen zum Ertragsausgleich vor, um sicherzustellen, dass die Höhe des innerhalb eines Fonds aufgelaufenen und jeder Aktie zugeordneten Nettoertrags nicht durch Ausgabe, Umwandlung oder Rücknahme von Fondsanteilen im Verlauf des Jahres beeinträchtigt wird.

Der Ertragsausgleich wird in den Veränderungen des Anteilskapitals in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens berücksichtigt.

(h) Verwässerung

Der Verwaltungsrat kann den Nettoinventarwert („NIW“) je Anteil eines Fonds anpassen, um die Folgen einer „Verwässerung“ bei diesem Fonds zu mindern. Eine Verwässerung tritt ein, wenn die effektiven Kosten für den Kauf oder Verkauf der zugrunde liegenden Vermögenswerte eines Fonds vom Buchwert dieser Vermögenswerte in der Bewertung des Fonds abweichen, und zwar aufgrund von Faktoren wie Handels- und Maklergebühren, Steuern und Abgaben, Marktbewegungen und einer etwaigen Spanne zwischen dem Kauf- und Verkaufspreis der zugrunde liegenden Vermögenswerte. Eine Verwässerung kann den Wert des Fonds beeinträchtigen und daher Auswirkungen auf alle Anteilinhaber haben. Durch die Anpassung des Nettoinventarwerts pro Anteil kann dieser Verwässerungseffekt reduziert oder vermieden und bestehende Anteilinhaber vor den negativen Einflüssen einer Verwässerung geschützt werden. Der Verwaltungsrat kann eine Anpassung des NIW eines Fonds vornehmen, wenn an einem Handelstag der Wert der gesamten Barmittelflüsse aller Anteilklassen jenes Fonds zu einem Nettoanstieg bzw. einem Nettorückgang führt, der einen oder mehrere vom Verwaltungsrat für jenen Fonds festgesetzte Grenzwerte überschreitet. Der Betrag, um den der NIW eines Fonds an einem Handelstag angepasst werden kann, hängt von den voraussichtlichen Kosten der für den Fonds getätigten Marktabschlüsse ab. Unter diesen Umständen kann der NIW des jeweiligen Fonds um einen Betrag angepasst werden, der 1,50 % oder, im Falle von Rentenfonds, 3 % des jeweiligen NIWs nicht übersteigt. In Ausnahmefällen kann der Verwaltungsrat im Interesse der Anteilinhaber beschließen, den oben angegebenen maximalen Swing-Faktor vorübergehend zu erhöhen und die Anleger darüber zu informieren. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettoveränderung zu einem Anstieg des Werts aller Anteile des Fonds führt, und zu einer Verminderung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettoveränderung zu einem Rückgang des Werts der Anteile führt.

Da an einigen Börsen sowie in bestimmten Jurisdiktionen beim Kauf und Verkauf unterschiedliche Gebühren anfallen können, insbesondere in Bezug auf Steuern und Abgaben, können die hieraus resultierenden Anpassungen für die Nettozuflüsse von denen der Nettoabflüsse abweichen. Darüber hinaus

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

kann der Verwaltungsrat beschließen, außerordentliche Steueraufwendungen in den Betrag der Anpassung mit einzubeziehen. Diese außerordentlichen Steueraufwendungen fallen auf jedem Markt in unterschiedlicher Höhe an und werden derzeit voraussichtlich 2,5% des NIW nicht übersteigen. Legt ein Fonds überwiegend in bestimmten Anlageklassen wie Staatsanleihen oder Geldmarktinstrumenten an, kann der Verwaltungsrat entscheiden, dass eine solche Anpassung nicht angemessen ist. In Übereinstimmung mit dem Verkaufsprospekt wurde eine derartige Verwässerungsanpassung zum 31. Mai 2023 beim BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund, beim BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund, beim BlackRock European Absolute Return Fund, beim BlackRock European Unconstrained Equity Fund und beim BlackRock UK Equity Absolute Return Fund vorgenommen.

Während des Berichtszeitraums vom 1. Juni 2022 bis zum 31. Mai 2023 wurden für alle Fonds Verwässerungsanpassungen vorgenommen.

Der veröffentlichte/für Anteilsgeschäfte maßgebliche NIW je Anteil wird in der Zusammenfassung der Nettoinventarwerte der letzten drei Jahre (auf den Seiten 30 bis 40) ausgewiesen und kann gegebenenfalls eine Verwässerungsanpassung beinhalten. Diese Anpassung wird in der Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens bzw. der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen nicht ausgewiesen.

(i) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind zusätzliche, direkt dem Erwerb, der Ausgabe oder Veräußerung von Wertpapieren oder Derivaten zurechenbare Kosten. Zusätzliche Kosten sind Kosten, die nicht angefallen wären, wenn eine Gesellschaft das Wertpapier nicht erworben, ausgegeben oder verkauft hätte. Beim Erstausweis wird ein Wertpapier mit seinem Marktwert zuzüglich der direkt dem Kauf oder der Ausgabe des Wertpapiers zurechenbaren Transaktionskosten angesetzt.

Die Transaktionskosten ohne Verwahrstellengebühren für Kauf oder Verkauf von Wertpapieren werden unter dem Posten realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs (oder -verlusts) in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens jedes Fonds berücksichtigt. Transaktionsgebühren der Verwahrstelle werden in den Verwahrstellengebühren der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens angegeben. Weitere Informationen finden Sie unter Anmerkung 6.

(j) Devisen aus anderen Transaktionen

Devisen aus anderen Transaktionen beziehen sich auf realisierte und nicht realisierte Wertzuwächse oder -verluste aus Bankguthaben und Kontrakten am Kassamarkt und werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen ausgewiesen.

3. Verwaltungsgesellschaft

Die Gesellschaft hat BlackRock (Luxembourg) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) zu ihrer Verwaltungsgesellschaft bestellt. Gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 ist die Verwaltungsgesellschaft ermächtigt, als Fondsverwaltungsgesellschaft zu fungieren.

Die Gesellschaft hat mit der Verwaltungsgesellschaft eine Verwaltungsvereinbarung unterzeichnet. Gemäß dieser Vereinbarung wurde der Verwaltungsgesellschaft das Tagesgeschäft der Gesellschaft übertragen, d.h. sie zeichnet direkt oder durch Übertragung der Aufgabe auf Dritte verantwortlich für sämtliche betriebliche Abläufe im Zusammenhang mit der Anlageverwaltung und der allgemeinen Verwaltung der Gesellschaft und dem Vertrieb der Fonds.

In Übereinstimmung mit der Gesellschaft hat die Verwaltungsgesellschaft beschlossen, bestimmte Aufgaben – wie im Prospekt beschrieben – an Dritte zu übertragen.

Die Verwaltungsgesellschaft ist eine hundertprozentige Tochtergesellschaft der BlackRock-Gruppe. Sie untersteht der Aufsicht durch die CSSF.

4. Verwaltungs- und Vertriebsgebühren

Im Verlauf des Berichtsjahres zahlte die Gesellschaft Managementgebühren an die Verwaltungsgesellschaft.

Die Gesellschaft zahlt eine jährliche Managementgebühr, wie in Anhang F des Prospekts aufgeführt. Die Managementgebühr beträgt zwischen 0,37% und 1,80% des NIW pro Jahr. Eine Ausnahme bilden die Anteile der Klasse X, bei denen keine Managementgebühr, sondern im Rahmen einer Vereinbarung Gebühren an die Anlageberater oder deren verbundene Unternehmen gezahlt werden. Die Höhe der Managementgebühren schwankt abhängig von Fonds und Anteilklasse, die der Anleger erwirbt. Diese Managementgebühren fallen täglich an, basierend auf dem NAV des jeweiligen Fonds, und werden monatlich gezahlt. Durch diese Managementgebühr werden bestimmte Kosten und Gebühren beglichen, u. a. auch die Gebühren für die Anlageberater.

Legt ein Fonds einen wesentlichen Teil seines Nettovermögens in anderen OGAW und anderen Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) an, stellt der Anlageberater sicher, dass die gesamten Managementgebühren (ohne Performancegebühren, sofern zutreffend), die dem jeweiligen Fonds in Rechnung gestellt werden (einschließlich der Managementgebühren der anderen OGAW bzw. OGA, in die er investiert), nicht mehr als 3,75% des NIW des Fonds betragen.

Bei folgenden Fonds war im Berichtsjahr im Zusammenhang mit Anlagen in von BlackRock verwaltete Zielfonds eine ermäßigte Managementgebühr zu zahlen, ausgewiesen in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Abschläge auf Managementgebühr“:

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund, BlackRock European Select Strategies Fund, BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative, BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth, BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate, BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund und BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund.

Bei allen nachfolgend aufgeführten Fonds kam es im Jahr zu einer Ausgabenerstattung von der Verwaltungsgesellschaft, ausgewiesen in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens unter „Erstattung von Ausgaben“:

BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund, BlackRock European Select Strategies Fund, BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, BlackRock Global Equity Absolute Return Fund, BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative, BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth, BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate, BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund, BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund, BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund und BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund.

Im Berichtsjahr bezahlte die Gesellschaft Vertriebsgebühren an BlackRock Investment Management (UK) Limited, die als Hauptvertriebsgesellschaft fungierte.

Die Gesellschaft zahlt jährliche Vertriebsgebühren zwischen 1,25% und 1,00% des NIW für Anteile der Klasse C, und 0,50% des NIW für Anteile der Klasse E. Diese Vertriebsgebühren fallen täglich an, sie basieren auf dem NIW des jeweiligen Fonds, wobei gegebenenfalls Anpassungen des NIW des betreffenden Fonds berücksichtigt werden, und sind monatlich zu zahlen.

Eine detaillierte Aufstellung zu den Verwaltungs- und Vertriebsgebühren je Anteilklasse und Fonds findet sich im Verkaufsprospekt der Gesellschaft und den jeweiligen Basisinformationsblättern („PRIIPs KID“). Die zum 31. Mai 2023 fälligen Management- und Vertriebsgebühren sind in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

5. Jährliche Servicegebühr

Die Gesellschaft zahlt der Verwaltungsgesellschaft eine jährliche Servicegebühr.

Die Höhe der Servicegebühr kann vom Verwaltungsrat in Absprache mit der Verwaltungsgesellschaft unterschiedlich festgesetzt werden; für die verschiedenen von der Gesellschaft ausgegebenen Fonds und Anteilsklassen gelten verschiedene Sätze. Zwischen dem Verwaltungsrat und der Verwaltungsgesellschaft wurde jedoch vereinbart, dass die gegenwärtige jährliche Servicegebühr höchstens 0,30% pro Jahr beträgt. Die Administrationsgebühr fällt täglich an, basiert auf dem NIW der jeweiligen Anteilklasse und wird monatlich gezahlt.

Der Verwaltungsrat und die Verwaltungsgesellschaft setzen die Höhe der jährliche Servicegebühr so fest, dass die Gesamtkostenquote jedes Fonds im Vergleich zu einem breiten Markt ähnlicher Anlageprodukte, die Anlegern der Fonds zur Verfügung stehen, wettbewerbsfähig bleibt, wobei verschiedene Kriterien berücksichtigt werden, etwa die jeweilige Branche eines Fonds und die Wertentwicklung eines Fonds gegenüber seiner Vergleichsgruppe.

Die jährliche Servicegebühr wird von der Verwaltungsgesellschaft zur Deckung aller bei der Gesellschaft anfallenden festen und variablen Betriebs- und Verwaltungskosten und -aufwendungen verwendet, mit Ausnahme der Verwahrgebühren, Vertriebsgebühren, aller Gebühren im Zusammenhang mit Darlehen (und um Missverständnissen vorzubeugen auch alle gegebenenfalls an den Darlehensgeber zu zahlenden Bereitstellungsprovisionen), Kosten für professionelle Dienstleistungen im Zusammenhang mit der Beantragung einer Rückerstattung von Quellensteuer (zuzüglich darauf anfallender Steuern oder Zinsen) sowie etwaiger auf Ebene der Anlagen oder auf Ebene der Gesellschaft fälliger Steuern. Bereitstellungsprovisionen für Darlehen oder etwaige Kosten für professionelle Dienstleistungen im Zusammenhang mit der Beantragung einer Rückerstattung von Quellensteuer werden auf angemessener und ausgewogener Basis auf die betreffenden Fonds umgelegt.

Zu den Betriebs- und Verwaltungskosten und -aufwendungen gehören alle Kosten Dritter und sonstige erstattungsfähige Kosten, die bei der Gesellschaft oder in deren Namen gegebenenfalls anfallen. Dazu gehören unter anderem Gebühren für die Rechnungslegung des Fonds, für die Übertragungsstelle (einschließlich Kosten einer nachgeordneten Übertragungsstelle und damit verbundene Kosten von Handelsplattformen), alle Kosten für Rechts- und Steuerberatung sowie sonstige Beratung, Prüfungsgebühren, Vergütungen für Verwaltungsratsmitglieder, Reisekosten, Auslagen in vertretbarer Höhe, Kosten für Druck, Veröffentlichung und Übersetzung sowie alle anderen Kosten im Zusammenhang mit der Berichterstattung an die Anteilinhaber und für bei Aufsichtsbehörden einzureichende Unterlagen, Lizenzgebühren, Korrespondenz- und sonstige Bankgebühren, Software-Support- und Wartungskosten, operative Kosten und Ausgaben für die Investor Servicing Teams sowie die Kosten für sonstige allgemeine Verwaltungsleistungen, die von verschiedenen Unternehmen der BlackRock-Unternehmensgruppe erbracht werden.

Die Verwaltungsgesellschaft übernimmt das finanzielle Risiko, um sicherzustellen, dass die Gesamtkostenquote der Fonds wettbewerbsfähig bleibt. Die Verwaltungsgesellschaft ist daher berechtigt, von der an sie bezahlten jährlichen Servicegebühr jeden Betrag, der über die tatsächlich der Gesellschaft in einem Jahr entstandenen Kosten hinausgeht, einzubehalten, während der Gesellschaft in einem Jahr entstandene Kosten und Auslagen, die über der an die Verwaltungsgesellschaft gezahlten jährlichen Servicegebühr liegen, von der Verwaltungsgesellschaft oder einer anderen Gesellschaft der BlackRock-Gruppe getragen werden.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

Die zum 31. Mai 2023 fällige jährliche Servicegebühr ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

Die Mitglieder des Verwaltungsrats der Gesellschaft, die keine Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe sind, erhielten für die Wahrnehmung ihrer Aufgaben während des zum 31. Mai 2023 endenden Berichtsjahres eine Vergütung in Höhe von 30.000 EUR brutto pro Jahr vor Steuern. Die Vorsitzende erhält eine Vergütung in Höhe von 33.500 EUR brutto pro Jahr vor Steuern. Verwaltungsratsmitglieder, die Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe sind, erhalten keine Vergütung für ihre Tätigkeit als Verwaltungsratsmitglied.

Nachfolgend aufgeführt sind die an Deloitte Audit S.à r.l. gezahlten Gebühren für das am 31. Mai 2023 abgeschlossene Geschäftsjahr.

| | 31. Mai 2023 EUR |
|---|---------------------|
| Prüfungs- und prüfungsbezogene Dienstleistungen (ohne MwSt.) | 429.000 |
| Nicht prüfungsbezogene Leistungen | – |

6. Verwahrstellengebühren

Die Verwahrstelle erhält für jeden Fonds eine Gebühr. Diese Gebühren dienen der Vergütung der Verwahrstelle für die Verwahrung und Transaktionskosten im Zusammenhang mit jedem Fonds.

Verwahrgebühren sind von den verwalteten Vermögenswerten und dem Land, in dem die Wert Vermögenswerte gehalten werden, abhängig. Die Transaktionsgebühren sind von der Art der Transaktion und dem Land, in dem die Transaktion vorgenommen wird, abhängig.

Die Handelsvolumen und Vermögensallokationen für jeden Fonds hängen von ihrer jeweiligen Anlagestrategie ab. Die gesamten Verwahrstellengebühren des einzelnen Fonds hängen zu jeder Zeit von seinen jeweiligen Vermögensallokationen und seiner Handelsaktivität ab.

Die zum 31. Mai 2023 fälligen Verwahrstellengebühren sind in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

7. Performancegebühr

Bei jeder Anteilklasse in jedem Fonds kann zusätzlich zu anderen Gebühren und Auslagen eine Performancegebühr fällig werden, wie im Verkaufsprospekt beschrieben. Eine Ausnahme bilden die Anteilklassen X, Vermögensanlage99, Vermögensstrategie und IndexInvest Chance, bei denen keine Performancegebühren gezahlt werden. Die Performancegebühr fällt an jedem Bewertungstag an und entspricht 8%, 20% oder 30% (wie für den entsprechenden Fonds zutreffend, siehe Anhang E des Verkaufsprospekts) des Betrags, um den die Eigenkapitalrendite die Rendite des entsprechenden Referenzindex übersteigt, der in Anhang E des Verkaufsprospekts genauer beschrieben wird. Zur Berechnung der Performancegebühr werden zwei als Typ

A und Typ B bezeichnete Methoden verwendet. Welche der beiden Methoden auf die einzelnen Fonds angewendet wird, ist Anhang E des Verkaufsprospekts zu entnehmen. Weitere Einzelheiten sind beim Investor Servicing Team vor Ort sowie am Geschäftssitz der Gesellschaft erhältlich.

Festgestellt wird die Performancegebühr am letzten Tag des Performancezeitraums (jeder Performancezeitraum im Sinne des Verkaufsprospekts der Gesellschaft) oder vorher, falls ein Anteilinhaber alle oder einen Teil seiner Anteile zurückgibt oder umtauscht.

Die zum 31. Mai 2023 fälligen Performancegebühren werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Performancegebühren“ ausgewiesen. Die Tabelle mit den Performancegebühren, die pro Einheitsklasse der jeweiligen Fonds erhoben werden, ist im Vermerk 16 enthalten.

8. Steuern

Die Luxemburger Zeichnungssteuer, belgische Steuer, die realisierte und nicht realisierte Kapitalertragsteuer sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Steuern“ ausgewiesen. Für das Berichtsjahr bis zum 31. Mai 2023 wurden Steuern in Höhe von 8.613.774 USD fällig. In Bezug auf die Kapitalertragsteuer betrug die realisierte Kapitalertragsteuer 2.364.087 USD und die nicht realisierte Kapitalertragsteuer 608.419 USD.

Luxemburg

Die Gesellschaft ist als Investmentgesellschaft nach Luxemburger Recht eingetragen. Demnach ist die Gesellschaft gegenwärtig von der luxemburgischen Einkommen- und Kapitalertragsteuer befreit. Sie ist lediglich einer jährlichen Zeichnungssteuer („taxe d’abonnement“) in Höhe von 0,05% des NIW von jedem Fonds zu jedem Quartalsende im Hinblick auf die Klasse I, Klasse IA, Klasse J, Klasse T, Klasse X und Klasse ZI in Höhe von 0,01% des NIW eines jeden Fonds zum jeweiligen Quartalsende unterworfen. Für das Berichtsjahr bis zum 31. Mai 2023 wurden in Luxemburg Zeichnungssteuern in Höhe von 5.504.484 USD fällig.

Belgien

Die Gesellschaft ist in Belgien bei den Finanzdienstleistungs- und Marktbehörden gemäß Artikel 154 des Gesetzes vom 3. August 2012 über Finanztransaktionen und Finanzmärkte registriert. Zum öffentlichen Vertrieb in Belgien zugelassene Fonds unterliegen einer jährlichen Steuer von 0,0925% auf den NIW der in Belgien über belgische Vermittler vertriebenen Anteile zum 31. Dezember des Vorjahres. Für das Berichtsjahr bis zum 31. Mai 2023 wurden in Belgien Steuern in Höhe von 77.968 USD fällig.

Vereinigtes Königreich

Reporting Funds

Für die Gesellschaft gilt die britische Regelung für Meldefonds. Nach dieser Regelung sind Anleger in UK Reporting Funds steuerpflichtig auf den Anteil an den Erträgen des UK Reporting Funds, der auf ihre Beteiligungen am Fonds entfällt,

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

unabhängig davon, ob sie ausgeschüttet werden oder nicht. Alle Gewinne aus der Veräußerung ihrer Bestände unterliegen der Kapitalertragssteuer. Eine Liste der Fonds, die aktuell den britischen Reporting-Fund-Status haben, ist erhältlich unter: <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>.

Sonstige Steuern auf Transaktionen

In anderen Jurisdiktionen können Steuern, Finanztransaktionssteuern („FTS“) oder andere Transaktionssteuern auf bestimmte von den Fonds gehaltene Vermögenswerte erhoben werden (zum Beispiel die Stempelsteuer in Großbritannien oder die FTS in Frankreich).

Quellensteuer

Etwaige Dividenden, Zinsen und Kapitalerträge, die die Gesellschaft für ihre Anlagen erhält, unterliegen möglicherweise einer Quellensteuer im Ursprungsland, die in der Regel nicht erstattungsfähig ist, da die Gesellschaft selbst von der Einkommensteuer befreit ist. Durch die aktuelle Rechtsprechung der Europäischen Union kann sich jedoch der Umfang dieser nicht erstattungsfähigen Steuer unter Umständen verringern. Anleger sollten sich über mögliche Steuerfolgen einer Zeichnung, eines Kaufs, des Haltens, der Rücknahme, des Umtauschs oder des Verkaufs von Anteilen nach dem Recht des Landes, deren Staatsangehörige sie sind bzw. in dem sie ihren Wohnsitz oder gewöhnlichen Aufenthalt haben, informieren und sich gegebenenfalls mit ihren professionellen Beratern in Verbindung setzen. Anleger sollten beachten, dass sich Höhe und Bemessungsgrundlage von Steuern sowie Freistellungen hiervon ändern können. Nähere Angaben zur Quellensteuer sind im Verkaufsprospekt enthalten.

Die Quellensteuer ist in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Dividenden, nach Abzug von Quellensteuern“ und „Anleihezinsen, nach Abzug von Quellensteuern“ enthalten.

Dividenden, welche die Gesellschaft auf CFD erhält, können der Quellensteuer unterliegen: Insbesondere die Quellensteuer für CFD auf US-Eigenkapitalinstrumenten wird gemäß Abschnitt 871 Buchstabe m des Internal Revenue Code („IRC“) geregelt. Diese Quellensteuer ist in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Rubrik „Dividenden aus Differenzkontrakten, nach Abzug von Quellensteuern“ enthalten.

9. Anlageberater und Unteranlageberater

Die Verwaltungsgesellschaft, BlackRock (Luxembourg) S.A., hat die Aufgaben und Leistungen der Anlageverwaltung und -beratung auf die folgenden Anlageberater übertragen: BlackRock Financial Management, Inc. (BFM), BlackRock Institutional Trust Company N.A. (BITC), BlackRock Investment Management LLC (BIMLLC), BlackRock Investment Management (UK) Limited (BIMUK) und BlackRock (Singapore) Limited (BSL), wie im Verkaufsprospekt dargelegt.

Die Anlageberater geben Empfehlungen und wirken bei der Verwaltung in den Bereichen Titel- und Branchenauswahl sowie

der strategischen Asset-Allokation mit. BIM UK hat einige seiner Funktionen an BlackRock Japan Co., Ltd. (BLKJap), BlackRock Investment Management (Australia) Limited (BIMAL) und BlackRock Asset Management North Asia Limited (BAMNA) übertragen. Ungeachtet der Bestellung der Anlageberater übernimmt die Verwaltungsgesellschaft die volle Verantwortung gegenüber der Gesellschaft für alle Anlagegeschäfte.

| Fonds | Anlageberater | Sub-Anlageberater |
|--|-------------------------|----------------------|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | BITC | - |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | BIMUK | BAMNA |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund | BIMUK, BIMLLC | BAMNA |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | BIMUK, BSL, BFM | - |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | BIMUK | - |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | BIMUK | BAMNA |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | BIMUK, BFM | - |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | BIMUK, BFM | - |
| BlackRock European Absolute Return Fund | BIMUK | - |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | BIMUK | - |
| BlackRock European Select Strategies Fund | BIMUK, BSL, BFM | BIMAL |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | BIMUK | - |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | BIMUK, BSL, BFM, BITC | BAMNA, BLKJap, BIMAL |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | BIMUK | - |
| BlackRock Global Event Driven Fund | BIMLLC | - |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | BIMUK, BIMLLC, BFM, BSL | BIMAL |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | BIMUK, BIMLLC | BAMNA |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | BIMUK, BIMLLC | BAMNA |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | BIMUK, BIMLLC | BAMNA |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | BIMUK, BIMLLC | BAMNA |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund ⁽¹⁾ | BIMLLC | - |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽²⁾ | BIMUK | BIMAL |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽²⁾ | BIMUK | - |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾ | BIMUK | - |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽²⁾ | BIMUK, BFM | - |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽²⁾ | BIMUK, BSL, BFM | BIMAL |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | BIMLLC | - |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund ⁽¹⁾ | BIMLLC | - |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | BFM | - |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | BIMUK | - |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

10. Geschäfte mit verbundenen Parteien

Die Muttergesellschaft der Verwaltungsgesellschaft, die Hauptvertriebsgesellschaft und der Anlageberater ist BlackRock, Inc., ein Unternehmen mit Sitz in Delaware, USA.

Während des Berichtsjahres wurden keine wesentlichen Transaktionen außerhalb des gewöhnlichen Geschäftsverlaufs oder zu nicht üblichen Bedingungen getätigt. Im Berichtszeitraum wurden keine Transaktionen der Gesellschaft über BlackRock-Gesellschaften abgewickelt.

Die Gesellschaft hat BlackRock Advisors (UK) Limited (die „Wertpapierleihstelle“), ein verbundenes Unternehmen der Gesellschaft, als Wertpapierleihstelle beauftragt. Die Wertpapierleihstelle trägt alle mit der Wertpapierleihe verbundenen operativen Kosten. Der Gesamtertrag aus Wertpapierleihtransaktionen wird zwischen dem entsprechenden Fonds und dem Vermittler der Wertpapierleihe aufgeteilt. Die Fonds, die Wertpapierleihgeschäfte durchführen, erhalten mindestens 62,5%, während die Wertpapierleihstelle bis zu 37,5% dieses Ertrags vereinnahmt.

Manche der Fonds nutzen Cross-Investment-Verfahren, d. h., sie investieren in andere Fonds innerhalb der Umbrella-Struktur der Gesellschaft. Die Aufstellung des Nettovermögens und die kombinierte Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen wurden nicht angepasst, um die Auswirkungen der Cross-Investments zu beheben. Provisionen auf Anteilszeichnungen und Rückzahlungen sowie Managementgebühren wurden nicht auf die Vermögenswerte des Fonds angewandt, der Kreuzbeteiligungen an anderen Fonds hält.

In der unten stehenden Tabelle wird der Wert dieser Cross-Investments im Anlagenportfolio des jeweiligen Fonds zum 31. Mai 2023 angegeben:

| Fonds | Fonds für Cross-Investments | Währung | Marktwert | % des Nettovermögens |
|--|--|---------|------------|----------------------|
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund | Blackrock Strategic Funds - Blackrock ESG Euro Corporate Bond Fund | EUR | 17.094.984 | 0,59 |

Sonstige Erstattungen

Während des Geschäftsjahres haben bestimmte Fonds der Gesellschaft von einer verbundenen Einheit der BlackRock-Gruppe Forderungen für Erstattungen für Strafen verbucht, die dem Fonds von den Zentralverwahrern für Verzögerungen bei Wertpapierabrechnungen in Rechnung gestellt wurden. In der nachstehenden Tabelle sind die für das zum 31. Mai 2023 endende Geschäftsjahr erzielten Erstattungen aufgeführt.

| Fonds | Währung | 31. Mai 2023 In Tsd. CCY |
|---|---------|--------------------------|
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 2.186 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 1.022 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 307 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | EUR | 77 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | EUR | 38 |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽¹⁾ | EUR | 2.705 |

| Fonds | Währung | 31. Mai 2023 In Tsd. CCY |
|--|---------|--------------------------|
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽¹⁾ | EUR | 482 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽¹⁾ | EUR | 5 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽¹⁾ | EUR | 1.268 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽¹⁾ | EUR | 46 |

⁽¹⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

11. Ausschüttungen

Für die thesaurierenden Anteilsklassen sieht die aktuelle Anlagepolitik des Verwaltungsrats eine Thesaurierung und Reinvestition sämtlicher Nettoerträge vor.

Bei ausschüttenden Anteilen sieht die Anlagepolitik eine substanzielle Ausschüttung des gesamten Anlageertrags (sofern verfügbar) für das Jahr nach Abzug der Aufwendungen (oder Bruttoertrag im Falle von G-Anteilen) vor. Der Verwaltungsrat kann darüber hinaus entscheiden, ob und in welcher Höhe realisierte und nicht realisierte Nettokapitalgewinne bei den Ausschüttungen berücksichtigt werden. In Fällen, in denen ausschüttende Anteilsklassen Dividenden auszahlen, die realisierte oder nicht realisierte Nettokapitalgewinne beinhalten, oder im Fall von Fonds, die Erträge vor Abzug von Gebühren ausschütten, können die Auszahlungen aus anfänglich gezeichnetem Kapital erfolgen. Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass auf diese Weise vorgenommene Ausschüttungen möglicherweise – in Abhängigkeit von den örtlichen Steuergesetzen – als Einkünfte zu versteuern sind; sie sollten diesbezüglich ihre persönlichen Steuerberater konsultieren.

Wenn ein Fonds mit UK Reporting-Status Erträge ausweist, die die vorgenommenen Ausschüttungen übersteigen, gilt der Überschuss als Ausschüttung und wird entsprechend als Ertrag gemäß dem Steuerstatus des Anlegers versteuert.

Die Gesellschaft kann Ertragsausgleichsvereinbarungen eingehen, um sicherzustellen, dass die Höhe des für einen Fonds aufgelaufenen Nettoertrags (oder Bruttoertrag im Falle von ausschüttenden Anteilen der Klasse G), der jedem Anteil zuzuteilen ist, nicht durch die Ausgabe, Umwandlung oder Rücknahme dieser Anteile im Verlauf eines Rechnungsjahres beeinträchtigt wird.

12. Wertpapierleihe

Die Tabelle unten zeigt den Wert der verliehenen Wertpapiere und die in diesem Zusammenhang erhaltenen Sicherheiten zum 31. Mai 2023:

| Fonds | Währung | Wert der verliehenen Wertpapiere | Wert erhaltener Sicherheiten |
|--|---------|----------------------------------|------------------------------|
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | USD | 1.719.830 | 2.492.348 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 29.723.530 | 33.186.621 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 8.292.430 | 10.012.096 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | USD | 107.705.068 | 122.396.717 |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Fonds | Währung | Wert der verliehenen Wertpapiere | Wert erhaltener Sicherheiten |
|--|---------|----------------------------------|------------------------------|
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | USD | 2.338.917 | 2.479.509 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | EUR | 16.602.764 | 18.783.870 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | EUR | 43.582.506 | 48.297.388 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 26.267.157 | 28.156.548 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | EUR | 674.857 | 730.650 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 656.401 | 709.065 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 129.990.071 | 146.064.248 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | USD | 55.069.281 | 62.709.269 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | EUR | 44.692 | 65.933 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | EUR | 5.302.683 | 7.822.952 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | EUR | 21.191.681 | 23.446.569 |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽¹⁾ | EUR | 85.926.265 | 95.044.580 |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽¹⁾ | EUR | 16.956.798 | 18.162.367 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽¹⁾ | EUR | 7.465.923 | 7.844.979 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽¹⁾ | EUR | 18.785.255 | 21.051.224 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund | EUR | 152.736.446 | 175.061.371 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | USD | 16.751.618 | 22.598.112 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund ⁽²⁾ | USD | 6.261.335 | 7.388.228 |

⁽¹⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

⁽²⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

Die im Geschäftsjahr aus Wertpapierleihtransaktionen erzielten Erträge werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Netto-Fondsvermögen ausgewiesen unter der Überschrift „Wertpapierleihe“. Die verliehenen Wertpapiere sind im Anlageportfolio jeweils gekennzeichnet.

13. Transaktionskosten

Zur Erreichung seines Anlageziels entstehen einem Fonds Transaktionskosten im Zusammenhang mit den Handelstätigkeiten in seinem Anlagenportfolio. In der nachstehenden Tabelle sind die einzeln abgrenzbaren Transaktionskosten ausgewiesen, die jedem Fonds für das zum 31. Mai 2023 endende Berichtsjahr entstanden sind. Diese Kosten umfassen Provisionskosten und Abwicklungsgebühren.

| Fonds | Währung | Transaktionskosten |
|--|---------|--------------------|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | 10.200 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | USD | 410.019 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | 8.306 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 122.489 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | GBP | 56.510 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 734.879 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | USD | 986 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | USD | 46 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | EUR | 371.609 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | EUR | 593.018 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 291.435 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | EUR | 24.010 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 8 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | USD | 38.290 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 384.097 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | USD | 1.738.327 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | EUR | 12.031 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | EUR | 15.002 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | EUR | 126.445 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | EUR | 143.065 |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund ⁽¹⁾ | USD | - |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽²⁾ | EUR | - |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽²⁾ | EUR | - |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾ | EUR | - |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽²⁾ | EUR | 11.055 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽²⁾ | EUR | 3 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | USD | 157.404 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund ⁽¹⁾ | USD | 85.474 |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | 339 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | GBP | 402 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Nicht alle Transaktionskosten sind gesondert feststellbar. Bei CFDs, Swaps, Devisentermingeschäften, Futures-Kontrakten, Optionen, Swap-Optionen und TBAs sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Diese Transaktionskosten sind zwar nicht einzeln abgrenzbar, werden jedoch von der Performance eines jeden Fonds erfasst. Die Kosten der Marktauswirkungen sind nicht einzeln feststellbar und daher nicht in der vorstehenden Tabelle erfasst.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

14. Kreditfazilität

Die Gesellschaft richtete eine Kreditfazilität bei JPMorgan Chase Bank, N.A. („JPMorgan“) ein, in deren Rahmen JPMorgan den Luxemburger Fonds zusammen mit anderen syndizierten Kreditgebern eine Kreditfazilität in Höhe von 1,23 Mrd. USD bereitstellt.

Diese Kreditfazilität können die Fonds für temporäre Finanzierungszwecke, unter anderem für Anteilsrücknahmen, nutzen. Etwaige Zinsgebühren und Provisionen, die durch die Inanspruchnahme der Kreditfazilität entstehen, werden aus dem Vermögen der entsprechenden Fonds bezahlt. Neue Fonds nehmen nicht automatisch an einer Kreditlinie teil. Sie müssen im Wege eines Beitrittsverfahrens hinzugefügt werden. Das Genehmigungsverfahren beinhaltet unter anderem jede erforderliche Due-Diligence-Prüfung durch die Kreditgeber. Während dieses Geschäftsjahres nehmen solche Fonds nicht an einer Kreditlinie teil und können diese nicht in Anspruch nehmen. Es ist zudem nicht gewährleistet, dass die Kreditgeber den Beitritt neuer Fonds zu der Kreditlinie genehmigen oder dass einem Fonds ein Kredit gewährt wird, da die Kreditlinie dem Vorbehalt der Verfügbarkeit (auf gerechter Zuteilungsbasis) zwischen den Fonds und anderen BlackRock Fonds, die an dem Kreditvertrag beteiligt sind, unterliegt. Demzufolge nehmen bestimmte Fonds unter Umständen nicht an der Kreditlinie teil und es werden ihnen diesbezüglich keine Kosten entstehen.

Eine Darlehensverpflichtungsgebühr wird in Bezug auf diese Kreditfazilität erhoben und ist in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter der Überschrift „Darlehensverpflichtungsgebühren“ enthalten. Die Darlehensverpflichtungsgebühr beträgt 0,10 % auf den zugesagten Betrag.

Während des am 31. Mai 2023 endenden Geschäftsjahres wurde die Kreditfazilität nicht in Anspruch genommen.

15. Forderungen/Verbindlichkeiten gegenüber Börsenmaklern

Die Forderungen/Verbindlichkeiten gegenüber Börsenmaklern in der Aufstellung des Nettofondsvermögens bestehen aus an Clearing-Stellen des Fonds und diverse Kontrahenten gezahlte oder von diesen erhaltene Barsicherheiten und Margenzahlungen.

Derivative Finanzinstrumente gegenüber Börsenmaklern

Die Fonds tätigen Transaktionen mit Derivaten mit zahlreichen Kontrahenten. Die Kontrahenten für die Derivate sind in der Vermögensaufstellung aufgeführt. Von der Gesellschaft werden an Kontrahenten Sicherheiten/Margenzahlungen auf derivative Finanzinstrumente geleistet bzw. die Gesellschaft erhält von Kontrahenten Sicherheiten/Margenzahlungen auf derivative Finanzinstrumente, um das Risiko des Kontrahenten gegenüber der Gesellschaft bzw. der Gesellschaft gegenüber dem Kontrahenten abzudecken. Die Forderungen gegenüber Brokern bestehen aus Barsicherheiten, die an Clearing Broker der Portfolios und diverse Kontrahenten gezahlt wurden. Die Verbindlichkeiten gegenüber Brokern bestehen aus an

Clearing Broker der Portfolios und diverse Kontrahenten gezahlte Barsicherheiten. Von Brokern geschuldete Derivate sind Teil der Bankguthaben, und an Broker geschuldete Derivate sind Teil der Barverbindlichkeiten gegenüber Banken in der Aufstellung des Nettovermögens. In der folgenden Tabelle sind die Forderungen/Verbindlichkeiten gegenüber Brokern für in bar erhaltene Sicherheiten zum 31. Mai 2023 aufgeführt. Die Barguthaben bei Derivatinstrumenten beziehen sich auf bei Brokern gehaltene Barmittel und werden teilweise dazu verwendet, die Margenanforderungen zum 31. Mai 2023 zu erfüllen.

| Fonds | Währung | Derivate Forderungen gegenüber Brokern | Derivate Verbindlichkeiten gegenüber Brokern |
|--|---------|--|--|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | 31.579.542 | - |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | USD | 1.381.927 | 3.204.319 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | 433.996 | 1.204.451 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 8.331.038 | 3.734.350 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | GBP | 4.790.225 | 7.216.473 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 18.732.559 | 3.689.472 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | USD | 20.658.740 | 8.844.087 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | USD | 2.589.494 | 662.311 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | EUR | - | 5.091.937 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | EUR | 5.486 | 451.710 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 5.184.055 | 60.677 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | EUR | - | - |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 9.962.187 | 341.696 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | USD | 1.010.417 | 155.006 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 126.619.386 | 1.052 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | USD | 28.250.164 | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | EUR | - | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | EUR | - | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | EUR | - | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | EUR | - | - |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund ⁽¹⁾ | USD | 9.011.529 | 2.207.704 |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽²⁾ | EUR | 3.748.794 | 536.519 |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽²⁾ | EUR | 1.423.644 | 407.582 |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Fonds | Währung | Derivate Forderungen gegenüber Brokern | Derivate Verbindlichkeiten gegenüber Brokern |
|--|---------|--|--|
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾ | EUR | 569.276 | 62.800 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽²⁾ | EUR | 13.219.560 | 89 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽²⁾ | EUR | 144.156.009 | 10.645.470 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | USD | 280.528 | - |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund ⁽¹⁾ | USD | 53.576 | 5 |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | USD | 350.580 | 14.229 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | GBP | 3.141.032 | 3.384.770 |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

16. Gesamtkostenquote (TER)

Die Gesamtkostenquote („TER“) wird berechnet, indem die gesamten Kosten (ausgenommen Bankzinsen, Aufwendungen für negative Renditen von finanziellen Vermögenswerten und rückerstattete Aufwendungen) durch das durchschnittliche Nettovermögen der Anteilklassen geteilt werden, ausgedrückt in Prozent auf Grundlage eines zum 31. Mai 2023 endenden Zwölfmonatszeitraums.

Die Managementgebühren dürfen teilweise zur Vergütung von Vertriebsaktivitäten für die Gesellschaft verwendet werden. Rückerstattungen sind an institutionelle Anleger möglich, die aus kaufmännischer Sicht Gesellschaftsanteile für Dritte halten.

Die TERs für das Jahr vom 1. Juni 2022 bis zum 31. Mai 2023 lauten wie folgt:

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|--|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽³⁾ | Auf AUD lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | 2,007% | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | 2,690% | USD | 1.340 | 0,673% |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 2,077% | USD | 39.322 | 0,073% |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 2,104% | USD | 23.550 | 0,093% |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 2,022% | USD | 26.256 | 0,017% |
| | Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 2,012% | USD | - | 0,005% |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 2,152% | USD | 173.747 | 0,643% |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,514% | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,779% | USD | 156.859 | 0,274% |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,709% | USD | 95 | 0,221% |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,519% | USD | 664 | 0,018% |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,270% | USD | 26.554 | 0,046% |
| | Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,342% | USD | 343.350 | 0,114% |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,245% | USD | 2.674 | 0,026% |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,339% | USD | 57.613 | 0,120% |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,222% | USD | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|---|---|-------------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,688 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,815 % | USD | 50 | 0,007 % |
| | Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,903 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,379 % | USD | 321 | 0,011 % |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,317 % | USD | 83 | 0,024 % |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,240 % | USD | 14 | 0,001 % |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,341 % | USD | 9 | 0,001 % |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,295 % | USD | 479 | 0,009 % |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,340 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,125 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,909 % | USD | 63 | 0,001 % |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z ⁽⁴⁾ | 2,240 % | USD | 142 | 0,321 % |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,859 % | USD | - | - |
| | BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ⁽³⁾ | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 3,661 % | USD | 483 |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | | 4,608 % | USD | 2.886 | 2,555 % |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | | 4,428 % | USD | 12.926 | 2,927 % |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | | 3,932 % | USD | 6.281 | 2,407 % |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | | 3,920 % | USD | 17.427 | 1,475 % |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | | 0,141 % | USD | - | - |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | | 0,133 % | USD | - | - |
| Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | | 2,265 % | USD | 3.159 | 1,325 % |
| Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | | 2,489 % | USD | 10.662 | 1,593 % |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | | 2,480 % | USD | 75.841 | 1,581 % |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund ⁽⁵⁾ | | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,559 % | EUR | - |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,574 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 1,556 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,867 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,057 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,638 % | EUR | - | - |
| | Auf CAD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,630 % | EUR | - | - |
| | Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,617 % | EUR | - | - |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,640 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 0,712 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,074 % | EUR | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|---|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 2,027 % | GBP | - | - |
| | Auf CNH lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,856 % | GBP | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,859 % | GBP | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,896 % | GBP | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,915 % | GBP | - | - |
| | Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,390 % | GBP | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,396 % | GBP | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,404 % | GBP | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,529 % | GBP | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,471 % | GBP | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,174 % | GBP | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,123 % | GBP | - | - |
| | Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,103 % | GBP | - | - |
| | Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,048 % | GBP | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,145 % | GBP | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,099 % | GBP | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,214 % | GBP | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 1,080 % | GBP | - | - |
| | Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,089 % | GBP | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 0,067 % | GBP | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 1,242 % | GBP | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 1,199 % | GBP | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 1,164 % | GBP | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 1,135 % | GBP | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|---|--|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,944 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,936 % | USD | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D | 1,424 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,437 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,436 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,439 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,439 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,436 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,442 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,145 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,148 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,156 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,838 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 0,836 % | USD | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|---|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund ⁽⁶⁾ | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,757 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,776 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,764 % | USD | - | - |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,767 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,754 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | 1,757 % | USD | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,028 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,007 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,004 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,005 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,006 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,028 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,007 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,023 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,279 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,272 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse I | 0,839 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I | 0,834 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil (G) der Klasse I | 0,837 % | USD | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 0,842 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,819 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 0,839 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse X | 0,070 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,088 % | USD | - | - |
| | Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,089 % | USD | - | - |
| | Auf CAD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,089 % | USD | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|---|---|------------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 0,924 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse AI | 0,977 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | 0,932 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,555 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,572 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse E | 1,421 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse E | 1,417 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,429 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,429 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I ⁽⁶⁾ | 0,494 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,504 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,103 % | USD | - | - |
| | BlackRock European Absolute Return Fund | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 2,259 % | EUR | 100.973 |
| Thesaurierender Anteil der Klasse A | | 2,259 % | EUR | 1.538.406 | 0,395 % |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D | | 1,862 % | EUR | 92.105 | 0,491 % |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | | 1,679 % | EUR | 83.335 | 0,321 % |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 1,814 % | EUR | 980.721 | 0,450 % |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 1,973 % | EUR | 53.344 | 0,600 % |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 1,943 % | EUR | 65.594 | 0,570 % |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | | 2,696 % | EUR | 105.689 | 0,332 % |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | | 1,556 % | EUR | 3.495.045 | 0,478 % |
| Thesaurierender Anteil der Klasse S | | 1,494 % | EUR | 68.688 | 0,428 % |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | | 0,081 % | EUR | - | - |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,876 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,877 % | EUR | 2.508 | 0,001 % |
| | Ausschüttender Anteil (G) der Klasse D | 1,375 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,367 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,384 % | EUR | 13.128 | 0,010 % |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,375 % | EUR | 490 | 0,001 % |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,229 % | EUR | 81.135 | 0,144 % |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,078 % | EUR | - | - |
| BlackRock European Select Strategies Fund ⁽⁵⁾ | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,578 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,578 % | EUR | - | - |
| | Auf CZK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,572 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 1,570 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D | 0,941 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,975 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse E | 2,075 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,077 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse I | 0,879 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,790 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,133 % | EUR | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ | |
|--|---|-------------------------------------|---|--|---|---|
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 5,436 % | EUR | 33.493 | 3,959 % | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,695 % | EUR | 160.664 | 0,811 % | |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 2,209 % | EUR | 27.233 | 1,322 % | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,664 % | EUR | 18.560 | 0,777 % | |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,768 % | EUR | 10.262 | 1,193 % | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,783 % | EUR | 60.861 | 1,186 % | |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 2,240 % | EUR | 152 | 1,654 % | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 0,092 % | EUR | - | - | |
| | BlackRock Global Absolute Return Bond Fund ⁽⁵⁾ | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,337 % | EUR | - | - |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,347 % | EUR | - | - | |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,347 % | EUR | - | - | | |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D | 0,850 % | EUR | - | - | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,850 % | EUR | - | - | | |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,771 % | EUR | - | - | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,849 % | EUR | - | - | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,658 % | EUR | - | - | | |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,660 % | EUR | - | - | | |
| Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,665 % | EUR | - | - | | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,159 % | EUR | - | - | | |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,861 % | USD | - | - | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,384 % | USD | - | - | |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,362 % | USD | - | - | |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,382 % | USD | - | - | |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,101 % | USD | - | - | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,099 % | USD | - | - | |
| | Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,101 % | USD | - | - | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,941 % | USD | - | - | |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,902 % | USD | - | - | |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,911 % | USD | - | - | |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 0,942 % | USD | - | - | |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|------------------------------------|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Global Event Driven Fund | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,856 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,857 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,853 % | USD | - | - |
| | Auf HKD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,852 % | USD | - | - |
| | Auf SGD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,853 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,848 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | 1,847 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,365 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,355 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,358 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,351 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,364 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,356 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,351 % | USD | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,068 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,057 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,075 % | USD | - | - |
| | Auf BRL lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,067 % | USD | - | - |
| | Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,075 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,068 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,068 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 1,069 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse IA | 0,574 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse IA | 0,571 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse S | 1,057 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S | 1,056 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,075 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,861 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 0,862 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 0,861 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 0,865 % | USD | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|---|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,521 % | USD | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,527 % | USD | - | - |
| | Auf AUD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,545 % | USD | - | - |
| | Auf CAD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,509 % | USD | - | - |
| | Auf CNH lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,655 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,537 % | USD | - | - |
| | Auf HKD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,533 % | USD | - | - |
| | Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,530 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,527 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,525 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,522 % | USD | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D | 0,933 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D ⁽⁶⁾ | 1,005 % | USD | - | - |
| | Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,939 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,929 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,022 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse I | 0,674 % | USD | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽⁶⁾ | 0,825 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽⁶⁾ | 0,799 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽⁶⁾ | 0,817 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽⁶⁾ | 0,799 % | USD | - | - |
| | Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status ⁽⁶⁾ | 0,801 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 0,803 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 0,805 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 0,803 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status | 0,809 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 0,093 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status | 0,627 % | USD | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ | |
|---|---|--|---|--|---|---|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ⁽⁵⁾ | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,129% | EUR | - | - | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,129% | EUR | - | - | |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,143% | EUR | - | - | |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D | 0,495% | EUR | - | - | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,500% | EUR | - | - | |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,501% | EUR | - | - | |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,497% | EUR | - | - | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,630% | EUR | - | - | |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽⁶⁾ | 0,471% | EUR | - | - | |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,431% | EUR | - | - | |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Balance | 1,127% | EUR | - | - | |
| | Vermögensanlage99 konservativ thesaurierender Anteil ⁽⁶⁾ | 1,177% | EUR | - | - | |
| | Vermögensstrategie Moderat - Ausgewogen ausschüttender Anteil | 0,481% | EUR | - | - | |
| | BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive ⁽⁵⁾ | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,126% | EUR | - | - |
| | | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,129% | EUR | - | - |
| | | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,129% | EUR | - | - |
| | | Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,127% | EUR | - | - |
| Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 0,499% | EUR | - | - | |
| Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 0,496% | EUR | - | - | |
| Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 0,502% | EUR | - | - | |
| Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | | 0,497% | EUR | - | - | |
| Auf PLN lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D ⁽⁶⁾ | | 0,506% | EUR | - | - | |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | | 0,501% | EUR | - | - | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 0,500% | EUR | - | - | |
| Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | | 0,501% | EUR | - | - | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse E | | 1,629% | EUR | - | - | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽⁶⁾ | | 0,474% | EUR | - | - | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse I | | 0,430% | EUR | - | - | |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | | 0,430% | EUR | - | - | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Substanz | | 1,126% | EUR | - | - | |
| Vermögensanlage99 defensiv thesaurierender Anteil ⁽⁶⁾ | | 1,171% | EUR | - | - | |
| Vermögensstrategie Defensiv ausschüttender Anteil | | 0,499% | EUR | - | - | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | | 0,052% | EUR | - | - | |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|--|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth ⁽⁵⁾ | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,124 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,134 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,133 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,129 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,499 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,499 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,500 % | EUR | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,496 % | EUR | - | - |
| | Auf PLN lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D ⁽⁶⁾ | 0,495 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,510 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,501 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,500 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,633 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse I ⁽⁶⁾ | 0,467 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,431 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,431 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Chance | 1,127 % | EUR | - | - |
| | Vermögensanlage99 dynamisch thesaurierender Anteil ⁽⁶⁾ | 1,162 % | EUR | - | - |
| | Vermögensstrategie Wachstum ausschüttender Anteil | 0,498 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,044 % | EUR | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|--|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate ⁽⁵⁾ | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,126 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,145 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,134 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,117 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,498 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,498 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,500 % | EUR | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,499 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,499 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,501 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,498 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,637 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse I | 0,439 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,432 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,431 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse IndexInvest Wachstum | 1,126 % | EUR | - | - |
| | IndexInvest Wachstum, auf CHF lautender, abgesicherter ausschüttender Anteil | 1,123 % | EUR | - | - |
| | Vermögensanlage99 progressiv thesaurierender Anteil ⁽⁶⁾ | 1,160 % | EUR | - | - |
| | Vermögensstrategie Ausgewogen ausschüttender Anteil | 0,500 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,043 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,060 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,064 % | EUR | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|---|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Systematic Style Factor Fund ⁽³⁾ | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,603 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,699 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,615 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,782 % | USD | - | - |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,602 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,078 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,027 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,070 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,075 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,073 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,120 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,241 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil PF der Klasse I | 0,783 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil PF der Klasse I | 0,784 % | USD | - | - |
| | Auf BRL lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,873 % | USD | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,880 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 0,880 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 0,880 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 0,883 % | USD | - | - |
| | Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I mit UK Reporting Fund-Status | 0,890 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,327 % | USD | - | - |
| | Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,338 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,321 % | USD | - | - |
| | Auf NZD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,083 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 0,334 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 1,017 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z | 1,023 % | USD | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|---|--|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽⁷⁾ | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 0,982 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,017 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 0,979 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK | | | | |
| | Reporting Fund-Status | 0,620 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,478 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,491 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil (G) der Klasse X | (0,179) % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,090 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,339 % | EUR | - | - |
| Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽⁶⁾ | 0,416 % | EUR | - | - | |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽⁷⁾ | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,178 % | EUR | - | - |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,031 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 1,020 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D | 0,619 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,622 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,523 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,478 % | EUR | - | - |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,482 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,081 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽⁶⁾ | 0,405 % | EUR | - | - |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽⁷⁾ | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 0,859 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 0,810 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,494 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,404 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,442 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,050 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse Z | 0,200 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse ZI ⁽⁶⁾ | 0,356 % | EUR | - | - |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ^{(5), (7)} | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,262 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,282 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 1,278 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D | 0,871 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,902 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,777 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,672 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,090 % | EUR | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|--|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ^{(6), (7)} | Ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,269 % | EUR | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,254 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 1,267 % | EUR | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,267 % | EUR | - | - |
| | Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,253 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,274 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,265 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 1,273 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse AI | 1,289 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse D | 0,873 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,875 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,856 % | EUR | - | - |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,869 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,877 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,869 % | EUR | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 0,879 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,771 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse I | 0,683 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,683 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,688 % | EUR | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse S ⁽⁶⁾ | 0,738 % | EUR | - | - |
| | Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S ⁽⁶⁾ | 0,738 % | EUR | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse S | 0,779 % | EUR | - | - |
| Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse S | 0,704 % | EUR | - | - | |
| Ausschüttender Anteil der Klasse X | 0,085 % | EUR | - | - | |
| Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,083 % | EUR | - | - | |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,029 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,631 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,532 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,469 % | USD | - | - |
| | Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,488 % | USD | - | - |
| | Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,491 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 0,084 % | USD | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|--|---|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund ⁽³⁾ | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 1,157 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 0,736 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,655 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 1,650 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,515 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse I | 0,512 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,115 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,114 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,114 % | USD | - | - |
| | Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,102 % | USD | - | - |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽³⁾ | Thesaurierender Anteil der Klasse A | 2,281 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 2,255 % | USD | - | - |
| | Auf SEK lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 2,277 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse AI | 2,211 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse C | 3,281 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,681 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,675 % | USD | - | - |
| | Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 1,680 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,769 % | USD | - | - |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,386 % | USD | - | - |
| | Ausschüttender Anteil der Klasse J | 1,690 % | USD | - | - |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X | 0,187 % | USD | - | - |

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

| Name des Fonds | Anteilklassen | TER (inkl. Performance-Gebühr) | Performance-gebühr Währung ⁽¹⁾ | Performance-gebühr Betrag ⁽¹⁾ | Performance-gebühr (als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens) ⁽²⁾ |
|--|--|--------------------------------|---|--|---|
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse A | 2,216 % | GBP | 15 | 0,365 % |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse A | 2,217 % | GBP | 15 | 0,366 % |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse A mit UK Reporting Fund-Status | 3,554 % | GBP | 136 | 1,565 % |
| | Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,658 % | GBP | 26 | 0,555 % |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,751 % | GBP | 78 | 0,635 % |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,467 % | GBP | 44 | 0,376 % |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D | 1,790 % | GBP | 52 | 0,684 % |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse D mit UK Reporting Fund-Status | 3,336 % | GBP | 692 | 2,130 % |
| | Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,813 % | GBP | 924 | 0,438 % |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse E | 2,676 % | GBP | 1.628 | 0,308 % |
| | Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,201 % | GBP | 47.819 | 0,367 % |
| | Auf JPY lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,367 % | GBP | 1.039.919 | 0,533 % |
| | Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse I | 1,573 % | GBP | 56.632 | 0,737 % |
| | Thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status | 0,080 % | GBP | - | - |

⁽¹⁾ In Fondswährung

⁽²⁾ Alle Zahlen werden annualisiert.

⁽³⁾ Fondsname geändert, Näheres hierzu siehe Anmerkung 17.

⁽⁴⁾ Der auf CHF lautende Hedged thesaurierende Anteil Z änderte seine Bewertungshäufigkeit im Geschäftsjahr von wöchentlich auf täglich. Dies führte dazu, dass die TER gemäß der AMAS-Methodik berechnet wurde, um die TER-Kennzahl in die Höhe zu treiben. Die auf der Grundlage des durchschnittlichen Gesamtvermögens aus 365 Tagen berechnete TER beträgt 1,09 %.

⁽⁵⁾ Fonds investiert in zugrunde liegende Zielfonds, die keine TER in Übereinstimmung mit der AMAS-Richtlinie veröffentlichen.

⁽⁶⁾ Auflegung einer neuen Anteilkategorie, nähere Informationen sind Anhang I zu entnehmen.

⁽⁷⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Die TERs wurden nach den Leitlinien der Asset Management Association Switzerland („AMAS“) zur Berechnung und Offenlegung der TER für Organismen für gemeinsame Anlagen berechnet. Die AMAS-Leitlinien wurden zuletzt am 1. Januar 2022 geändert.

Bestimmte Fonds, wie vorstehend angegeben, investieren einen erheblichen Teil ihres Nettovermögens in zugrunde liegende Zielfonds, die keine TER in Übereinstimmung mit der AMAS-Richtlinie publizieren. Daher ist die anteilige TER der zugrundeliegenden Zielfonds nicht in die TER der vorstehend dargestellten Fonds eingeflossen. Dieser Verzicht auf eine Berechnung erfolgt in Übereinstimmung mit der AMAS-Richtlinie.

17. Weitere Ereignisse

Am 1. August 2023 wurde ein neuer Verkaufsprospekt herausgegeben.

Mit Wirkung zum 1. August 2023 wurde der BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund in BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 1. August 2023 wurde der BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund in BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 1. August 2023 wurde der BlackRock Style Advantage Fund in BlackRock Systematic Style Factor Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 1. August 2023 wurde der BlackRock Systematic Global Equity Fund in BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 1. August 2023 wurde der BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund in BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund umbenannt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss Fortsetzung

Mit Wirkung zum 2. August 2023 wurde Arendt & Medernach SA zum Rechtsberater ernannt.

Mit Wirkung zum 3. August 2023 erfolgte die Auflegung des auf USD lautenden BlackRock Health Sciences Absolute Return Fund.

Es gab es keine weiteren Ereignisse nach dem Ende des Geschäftsjahrs und bis zum Datum der Genehmigung des Jahresabschlusses, die nach Auffassung des Verwaltungsrats wesentliche Auswirkungen auf den Jahresabschluss für das zum 31. Mai 2023 endende Geschäftsjahr haben könnten.

18. Genehmigungsdatum

Der Verwaltungsrat hat den Jahresabschluss am 26. September 2023 genehmigt.

An die Anteilhaber der
BlackRock Strategic Funds
49, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

BERICHT DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss für BlackRock Strategic Funds (die „Gesellschaft“) und alle ihre Teilfonds, bestehend aus der Aufstellung des Nettovermögens und dem Portfolio der Anlagen zum 31. Mai 2023 sowie der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen im Netto-Fondsvermögen für das abgeschlossene Berichtsjahr, sowie die Anmerkungen zum Jahresabschluss, einschließlich der Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze, geprüft.

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss, in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften für die Aufstellung und Darstellung von Jahresabschlüssen, ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Gesellschaft und ihrer einzelnen Teilfonds zum 31. Mai 2023 sowie der Ertragslage und der Veränderungen ihres Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt endende Berichtsjahr.

Die Grundlage für unser Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers (Gesetz vom 23. Juli 2016) und den international anerkannten Grundsätzen zur Abschlussprüfung (International Standards on Auditing, ISA) in ihrer für Luxemburg durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) verabschiedeten Fassung durchgeführt. Unsere Aufgaben im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der Standards, wie sie laut CSSF in Luxemburg anzuwenden sind, sind eingehender im Abschnitt „Zuständigkeiten des unabhängigen Abschlussprüfers bei der Prüfung von Jahresabschlüssen“ unseres Berichtes dargestellt. Wir sind ferner gemäß des Ethik-Kodex des International Ethics Standards Board for Accountants, einschließlich des International Independence Standards (IESBA-Kodex), der für Luxemburg von der *Commission de Surveillance du Secteur Financier* (CSSF) verabschiedet wurde, und in Übereinstimmung mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfungen von Jahresabschlüssen von Bedeutung sind, dem Gebot der Unabhängigkeit von der Gesellschaft verpflichtet und haben unsere berufsethischen Verantwortlichkeiten gemäß diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu bilden.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist für die sonstigen Angaben verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht aufgeführten Informationen, nicht jedoch den Jahresabschluss und den Prüfbericht des unabhängigen Abschlussprüfers hierzu.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen und wir geben hierzu keinerlei abschließende Feststellung ab.

In Verbindung mit unserer Prüfung der Abschlüsse sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen Informationen zur Kenntnis zu nehmen und hierbei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen in wesentlichem Widerspruch zu den Abschlüssen oder unseren bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnissen stehen oder anderweitig wesentliche Fehldarstellungen zu enthalten scheinen. Wenn wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Tätigkeiten wesentliche Falschaussagen dieser sonstigen Informationen feststellen, sind wir verpflichtet, hierauf hinzuweisen. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

Verantwortungen des Verwaltungsrats der Gesellschaft für die Jahresabschlüsse

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist für die Erstellung und korrekte Darstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen in Luxemburg sowie für eine interne Kontrolle verantwortlich. Die interne Kontrolle erfolgt nach Ermessen des Verwaltungsrats der Gesellschaft bei der Aufstellung des Jahresabschlusses. Es ist erforderlich, dass der Jahresabschluss keine wesentlichen unzutreffenden Angaben - ob beabsichtigt oder unbeabsichtigt - erhalten darf.

Im Rahmen der Erstellung von Jahresabschlüssen zählt es zu den Aufgaben des Verwaltungsrats der Gesellschaft, die Fähigkeit des Fonds, seine Unternehmenstätigkeit fortzuführen, zu bewerten, gegebenenfalls Umstände offenzulegen, die für die Fortführung der Unternehmenstätigkeit von Belang sind, die Rechnungslegung nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung auszurichten, es sei denn, der Verwaltungsrat der Gesellschaft beabsichtigt entweder den Fonds aufzulösen oder den Betrieb einzustellen oder er hat keine realistische Alternative dazu.

Verantwortlichkeiten des unabhängigen Abschlussprüfers für die Prüfung der Jahresabschlüsse

Ziel unserer Prüfung ist es, mit hinreichender Sicherheit zu beurteilen, ob der Jahresabschluss insgesamt frei von wesentlichen Fehldarstellungen, sei es aufgrund beabsichtigter oder unbeabsichtigter Fehler, ist, und einen Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers zu erstellen, der unser Prüfungsurteil enthält. Eine hinreichende Sicherheit bedeutet ein hohes Maß an Sicherheit, ist aber gleichwohl aber keine Garantie dafür, dass eine gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg angenommenen ISA durchgeführte Prüfung jede vorliegende wesentliche Fehldarstellung aufdeckt. Fehldarstellungen können beabsichtigt oder unbeabsichtigt sein und sind als wesentlich anzusehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern, die auf der Grundlage dieser Abschlüsse getroffen werden, beeinflussen können.

Im Rahmen einer Prüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg verabschiedeten ISA üben wir während der gesamten Prüfung ein pflichtgemäßes Ermessen aus und behalten eine kritische Grundhaltung bei. Ferner unternehmen wir Folgendes:

- Ermittlung und Beurteilung der Risiken wesentlicher Fehldarstellungen des Jahresabschlusses, sei es aufgrund beabsichtigter oder unbeabsichtigter Fehler, durch Planung und Durchführung von Prüfverfahren, die diesen Risiken Rechnung tragen, sowie durch Erlangung von Prüfungsnachweisen, die ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu bilden. Das Risiko, eine wesentliche Fehldarstellung aufgrund beabsichtigter Fehler nicht aufzudecken, ist höher als dasjenige, das sich aus einem unbeabsichtigten Fehler ergibt, da beabsichtigte Fehler mit betrügerischen Absprachen, Fälschungen, absichtlichen Unterlassungen, Falschdarstellungen oder der Außerkraftsetzung der internen Kontrolle einhergehen können.
- Erlangung eines Verständnisses der für die Prüfung relevanten internen Kontrollen, um angemessene Prüfverfahren zu entwickeln, jedoch nicht, um ein Urteil über die Wirksamkeit der internen Kontrolle der Gesellschaft abzugeben.

- Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und der Angemessenheit der vom Verwaltungsrat der Gesellschaft vorgenommenen Schätzungen und diesbezüglichen Angaben;
- Feststellung, ob die Anwendung der Fortführungsgrundsätze der Rechnungslegung durch den Verwaltungsrat der Gesellschaft angemessen ist, und, anhand der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Bedingungen besteht, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung aufkommen lassen können. Wenn wir feststellen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers auf die entsprechenden Angaben im Jahresabschluss hinzuweisen oder, wenn diese Angaben nicht ausreichen, unser Prüfungsurteil zu ändern. Unsere Feststellungen beruhen auf den Prüfungsnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Berichts des unabhängigen Abschlussprüfers erhalten haben. Danach eintretende Ereignisse oder Bedingungen können daher durchaus dazu führen, dass die Gesellschaft nicht mehr fortgeführt wird.
- Beurteilung der Gesamtdarstellung, der Struktur und des Inhalts des Jahresabschlusses einschließlich der Angaben sowie der Frage, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt wird.

Wir stehen mit den für die Verwaltung Verantwortlichen in Kontakt, u. a. in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitpunkt der Prüfung sowie in Bezug auf wesentliche Feststellungen, einschließlich aller wesentlichen Mängel in der internen Kontrolle, die wir im Rahmen unserer Prüfung festgestellt haben.

Für Deloitte Audit, *Cabinet de révision agréé*

Virginie Ng Wing Lit - Boulot, *Réviseur d'entreprises agréé*
Partner

26. September 2023

Anhang I – Anteilklassen (ungeprüft) Fortsetzung

Klasse Vermoegensanlage99⁽¹⁾

Vermoegensanlage99 defensiv auf EUR lautender thesaurierender Anteil
 Vermoegensanlage99 dynamisch auf EUR lautender thesaurierender Anteil
 Vermoegensanlage99 konservativ auf EUR lautender thesaurierender Anteil
 Vermoegensanlage99 progressiv auf EUR lautender thesaurierender Anteil

Klasse Vermoegensstrategie⁽¹⁾

Vermögensstrategie Ausgewogen auf EUR lautender ausschüttender Anteil
 Vermögensstrategie Defensiv auf EUR lautender ausschüttender Anteil
 Vermögensstrategie Moderat - Ausgewogen auf EUR lautender ausschüttender Anteil
 Vermögensstrategie Wachstum auf EUR lautender ausschüttender Anteil

Klasse X⁽²⁾

Auf EUR lautender ausschüttender Anteil (G) der Klasse X
 Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse X
 Auf AUD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf CAD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf JPY lautender thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf NZD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X

Auf USD lautender thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X
 Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status
 Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status
 Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status
 Auf USD lautender thesaurierender Anteil der Klasse X mit UK Reporting Fund-Status

Klasse Z⁽¹⁾

Auf CHF lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z
 Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse Z
 Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z
 Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse Z
 Auf USD lautender thesaurierender Anteil der Klasse Z
 Auf EUR lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status
 Auf GBP lautender thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status
 Auf GBP lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status
 Auf USD lautender thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status
 Auf USD lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse Z mit UK Reporting Fund-Status

Klasse ZI^{(1), (2)}

Auf EUR lautender thesaurierender Anteil der Klasse ZI

⁽¹⁾ Nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft verfügbar.

⁽²⁾ Für institutionelle Anleger verfügbar.

Auflegung von Anteilklassen

Die angegebenen Daten sind die Auflegungs- und Reaktivierungsdaten, wobei die genannten Anteilklassen erst zu einem späteren Zeitpunkt zur Zeichnung bereitstehen können.

| Datum des Inkrafttretens | Fonds | Typ |
|--------------------------|---|--|
| 22. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | Ausschüttender Anteil der Klasse I |
| 22. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | Ausschüttender Anteil der Klasse I |
| 22. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | Ausschüttender Anteil der Klasse I |
| 29. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | Vermoegensanlage99 konservativ thesaurierender Anteil |
| 29. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | Auf PLN lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D |
| 29. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | Vermoegensanlage99 defensiv thesaurierender Anteil |
| 29. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | Auf PLN lautender hedged thesaurierender Anteil der Klasse D |
| 29. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | Vermoegensanlage99 dynamisch thesaurierender Anteil |
| 29. Juni 2022 | BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | Vermoegensanlage99 progressiv thesaurierender Anteil |
| 27. Juli 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status |
| 27. Juli 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf CHF lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status |
| 27. Juli 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf EUR lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status |
| 27. Juli 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf GBP lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status |
| 27. Juli 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf SGD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S mit UK Reporting Fund-Status |
| 10. August 2022 | BlackRock Global Real Asset Securities Fund | Auf GBP lautender ausschüttender Anteil der Klasse D |
| 14. September 2022 | BlackRock Sustainable Euro Bond Fund | Thesaurierender Anteil der Klasse ZI |
| 14. September 2022 | BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund | Thesaurierender Anteil der Klasse ZI |
| 14. September 2022 | BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund | Thesaurierender Anteil der Klasse ZI |
| 16. November 2022 | BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | Thesaurierender Anteil der Klasse I |
| 15. Februar 2023 | BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund | Auf EUR lautender ausschüttender Anteil der Klasse S |
| 15. Februar 2023 | BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund | Auf USD lautender hedged ausschüttender Anteil der Klasse S |

Anhang II – Globales Marktrisiko (ungeprüft)

Gesamtengagement

Gemäß der aktuellen Anlagepolitik von BlackRock wird das Gesamtengagement anhand des „Commitment-Ansatzes“ oder der Value-at-Risk-Methode („VaR“-Methode) gemessen, die sämtliche Bestandteile des Portfolios berücksichtigt.

Der Commitment-Ansatz ist ein Verfahren, bei dem die zugrunde liegenden Markt- oder Nennwerte der Finanzderivate zusammengefasst werden, um das Gesamtrisiko eines Fonds aus Finanzderivaten zu bestimmen.

Gemäß dem Gesetz von 2010 darf bei einem Fonds, der den Commitment-Ansatz anwendet, das Gesamtmarktrisiko 100 % des Nettovermögens dieses Fonds nicht übersteigen.

Folgende Fonds wenden den Commitment-Ansatz an:

- BlackRock European Unconstrained Equity Fund
- BlackRock Global Real Asset Securities Fund
- BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative
- BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive
- BlackRock Managed Index Portfolios – Growth
- BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate
- BlackRock Systematic ESG World Equity Fund
- BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund

VaR ist eine statistische Maßzahl für das Risiko, mit der die möglichen Verluste als Folge negativer Marktbewegungen in einem normalen Marktumfeld geschätzt werden.

Die VaR-Berechnungen für die BlackRock Strategic Funds basieren mit Ausnahme des BlackRock Global Event Driven Funds auf einem bereinigten historischen Simulationsmodell. Das für den BlackRock Global Event Driven Fund verwendete VaR-Modell ist ein Monte Carlo-Simulationsmodell. Beide Modelle verwenden einem Konfidenzniveau von 99 %, eine Haltedauer von einem Tag und einen historischen Beobachtungszeitraum von mindestens einem Jahr (250 Tage). Der VaR-Wert wird anhand einer gegebenen Wahrscheinlichkeit und eines gegebenen Zeithorizonts ermittelt. Ein VaR von 99 % für 1 Tag bedeutet, dass angenommen wird, dass in 99 % der Zeit über den Zeitraum eines Tages der Fonds höchstens diesen Wert, als Prozentsatz angegeben, verlieren wird. Höhere VaR-Werte deuten daher auf ein höheres Risiko hin.

Das VaR-Modell, das bei der „Risk & Quantitative Analysis (RQA)“ von BlackRock verwendet wird, ist ein bereinigtes historisches Simulationsmodell.

Für die Fonds, die einen relativen VaR-Ansatz verwenden, erstellt die Abteilung RQA ein Referenzportfolio als Grundlage für die vergleichende VaR-Berechnung. Dabei entspricht das Referenzportfolio im Allgemeinen dem Referenzindex, der auch als Vergleichsmaßstab für die Wertentwicklung des entsprechenden Fonds herangezogen wird. Dieser Referenzindex (oder ein aus verschiedenen Teilindizes zusammengesetzter Referenzindex) wird von einem anerkannten Indexanbieter aus Wertpapieren zusammengestellt, in die die Fonds gemäß ihrer Anlagerichtlinien anlegen dürfen. Mit dieser Vorgehensweise wird die Verfügbarkeit von Indizes mit entsprechenden Indexregeln sichergestellt, die ihrerseits Diversifizierungsregeln einhalten.

Bei Fonds, die anhand der VaR-Methode überwacht werden, beobachten die Anlageberater die Einhaltung der aufsichtsrechtlich vorgegebenen Grenzen und aller internen, für den Fonds angemessen erscheinenden Risikogrenzen.

In der folgenden Tabelle ist die höchste, niedrigste und durchschnittliche Ausnutzung der VaR-Grenzen in Prozent der jeweiligen absoluten oder relativen VaR-Grenze der Regulierungsbehörde angegeben. Für die Fonds, die einen relativen VaR-Ansatz verwenden, darf der VaR des entsprechenden Fondsportfolios das Doppelte des VaR des Referenzportfolios nicht übersteigen. Die angegebene Ausnutzung bezieht sich auf das in diesem Kontext eingegangene Risikoniveau.

| Fonds | Gesamtrisikoansatz | Referenzportfolio | Höchste Ausnutzung der VaR-Grenze in % | Niedrigste Ausnutzung der VaR-Grenze in % | Durchschnittliche Ausnutzung der VaR-Grenze in % |
|--|--------------------|-----------------------|--|---|--|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 35,79 % | 19,02 % | 29,54 % |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 26,85 % | 18,12 % | 22,17 % |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 26,17 % | 14,32 % | 22,10 % |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 35,79 % | 16,33 % | 26,11 % |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 46,76 % | 25,28 % | 33,44 % |
| | | MSCI Emerging Markets | | | |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | Relativer VaR | Index | 59,58 % | 47,40 % | 54,23 % |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 36,02 % | 19,91 % | 28,18 % |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 31,32 % | 12,08 % | 20,31 % |
| BlackRock European Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 25,73 % | 15,88 % | 19,83 % |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | Relativer VaR | S&P Europe BMI Index | 56,15 % | 45,05 % | 50,68 % |

Anhang II – Globales Marktrisiko (ungeprüft) Fortsetzung

| Fonds | Gesamtrisikansatz | Referenzportfolio | Höchste Ausnutzung der VaR-Grenze in % | Niedrigste Ausnutzung der VaR-Grenze in % | Durchschnittliche Ausnutzung der VaR-Grenze in % |
|--|-------------------|---|--|---|--|
| | | 75 % Barclays Pan European Aggregate Index (Hedged EUR) / 25 % MSCI Europe Index (Hedged EUR) | | | |
| BlackRock European Select Strategies Fund | Relativer VaR | | 56,81 % | 42,86 % | 48,34 % |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 25,50 % | 7,83 % | 13,72 % |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 57,05 % | 15,88 % | 23,29 % |
| BlackRock Global Event Driven Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 59,96 % | 30,19 % | 43,91 % |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund ⁽¹⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 41,16 % | 19,69 % | 26,75 % |
| | | Bloomberg Barclays MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Index | | | |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽²⁾ | Relativer VaR | | 53,34 % | 48,23 % | 50,87 % |
| | | Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate Sustainable SRI Index | | | |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽²⁾ | Relativer VaR | | 56,65 % | 48,01 % | 52,38 % |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 12,98 % | 6,49 % | 9,90 % |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽²⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 29,75 % | 8,72 % | 15,59 % |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽²⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 26,62 % | 7,83 % | 14,46 % |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | Absoluter VaR | Entfällt | 36,69 % | 17,45 % | 24,37 % |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | Absoluter VaR | Entfällt | 24,61 % | 11,63 % | 16,22 % |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Leverage

Durch den Einsatz von Derivaten können Fonds höheren Risiken ausgesetzt sein. So können insbesondere Derivatekontrakte hohen Schwankungen unterliegen, und der Anfangseinschuss ist in der Regel im Vergleich zum Kontraktvolumen gering, sodass das Marktrisiko der Transaktionen Gegenstand einer Hebelwirkung sein kann. Vergleichsweise geringe Marktbewegungen können deutlich stärkere Auswirkungen auf Derivate als auf herkömmliche Anleihen oder Aktien haben. Derivatepositionen, die Gegenstand einer solchen Hebelwirkung sind, können daher die Volatilität innerhalb der Fonds verstärken.

Im Sinne dieses Hinweises bezeichnet Leverage das Anlageengagement, das über den Einsatz von Finanzderivaten erzielt wird. Berechnet wird die Leverage als Summe der rechnerischen Werte aller vom betreffenden Fonds gehaltenen Finanzderivate, ohne Netting, und wird als Prozentsatz des NIW ausgedrückt.

In der folgenden Tabelle wird die Höhe des Leverage während des Berichtsjahres für die entsprechenden Fonds angegeben.

| Fonds | Durchschnittlich eingesetztes Leverage |
|--|--|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | 662,36 % |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | 86,11 % |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | 456,88 % |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | 132,09 % |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | 126,09 % |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | 80,48 % |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | 387,16 % |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | 170,87 % |
| BlackRock European Absolute Return Fund | 70,01 % |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | 71,34 % |
| BlackRock European Select Strategies Fund | 129,33 % |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | 902,91 % |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | 143,48 % |
| BlackRock Global Event Driven Fund | 70,96 % |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund ⁽¹⁾ | 894,53 % |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund ⁽²⁾ | 59,05 % |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund ⁽²⁾ | 87,10 % |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾ | 87,90 % |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund ⁽²⁾ | 189,89 % |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund ⁽²⁾ | 624,41 % |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾ | 482,18 % |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | 132,91 % |

⁽¹⁾ Name des Fonds wurde nach Jahresende geändert, nähere Informationen sind Erläuterung 17 zu entnehmen.

⁽²⁾ Geänderter Fondsname. Nähere Informationen sind Erläuterung 1 zu entnehmen.

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung

Der Verwaltungsrat kann, vorbehaltlich der durch die CSSF und im Prospekt festgelegten Bedingungen und Grenzen, im Namen jedes Fonds Techniken und Instrumente im Zusammenhang mit Wertpapieren einsetzen, einschließlich Investitionen in derivativen OTC-Finanzinstrumenten („FDI“, Financial Derivative Instruments), sofern diese Techniken und Instrumente für ein effizientes Portfoliomanagement, zum Schutz gegen das Wechselkursrisiko oder gegebenenfalls für direkte Anlagezwecke eingesetzt werden.

Das durch FD entstehende zugrunde liegende Risiko und die Identität der Kontrahenten dieser FD zum Ende des Geschäftsjahres sind in der verkürzten Vermögensaufstellung des jeweiligen Fonds ausgewiesen.

Wertpapierleihe

Sämtliche von den Fonds eingegangenen Wertpapierleihtransaktionen unterliegen einer schriftlichen, rechtsverbindlichen Vereinbarung zwischen den Fonds und der Wertpapierleihstelle, BlackRock Advisors (UK) Limited, einem verbundenem Unternehmen der Gesellschaft, sowie einer gesonderten Vereinbarung zwischen der Wertpapierleihstelle und der genehmigten entleihenden Gegenpartei. Im Austausch für entlehene Wertpapiere erhaltene Sicherheiten werden im Rahmen einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung auf ein Konto bei einem dritten Sicherheitenverwalter im Namen der Verwahrstelle im Auftrag der Fonds übertragen und dort gehalten. Die entgegengenommenen Sicherheiten werden von dem Vermögen der Verwahrstelle oder der Wertpapierleihstelle getrennt gehalten.

Die folgende Tabelle gibt den Wert der verliehenen Wertpapiere als Anteil an den gesamten verleihbaren Vermögenswerten und als Anteil am NIW des Fonds zum 31. Mai 2023 und die Erträge/Renditen für das Jahr bis zum 31. Mai 2023 an. Die gesamten verleihbaren Vermögenswerte stellen den Gesamtwert der Vermögenswerte dar, die Teil des Wertpapierleihprogramms eines Fonds sind. Nicht darin enthalten sind alle vom Fonds gehaltenen Vermögenswerte, die aufgrund von Markt-, Regulierungs-, Anlage- oder sonstigen Beschränkungen nicht als verleihbar eingestuft werden.

| Fonds | Währung | Verliehene Wertpapiere | | Erzielte Erträge |
|---|---------|-----------------------------------|-----------|------------------|
| | | % der verleihbaren Vermögenswerte | % des NIW | |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | USD | 5,10 % | 2,27 % | 523 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 8,47 % | 3,79 % | 257.245 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | GBP | Entfällt | Entfällt | 51 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 3,38 % | 1,85 % | 166.773 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund | USD | 16,79 % | 10,87 % | 234.867 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund | USD | 3,25 % | 2,79 % | 20.626 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | EUR | 4,34 % | 1,22 % | 75.902 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | EUR | 8,26 % | 7,19 % | 57.835 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 11,26 % | 8,41 % | 68.823 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund | EUR | 1,24 % | 1,17 % | 4.050 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 1,20 % | 0,69 % | 39.586 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 11,30 % | 3,78 % | 980.727 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | USD | 7,27 % | 5,67 % | 65.728 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative | EUR | Entfällt | Entfällt | 1.363 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive | EUR | 0,03 % | 0,03 % | 3.853 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth | EUR | 1,19 % | 1,13 % | 29.034 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate | EUR | 3,44 % | 3,27 % | 16.125 |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund | EUR | 15,14 % | 12,94 % | 65.376 |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund | EUR | 8,64 % | 7,50 % | 37.984 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund | EUR | 6,95 % | 5,79 % | 7.696 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund | EUR | 9,17 % | 7,18 % | 90.529 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund | EUR | 7,82 % | 5,30 % | 743.186 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund | USD | 4,38 % | 4,07 % | 89.112 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund | USD | 5,01 % | 4,46 % | 38.195 |

Der Gesamtertrag aus Wertpapierleihgeschäften wird zwischen dem betreffenden Fonds und der Wertpapierleihstelle aufgeteilt. Die Fonds erhalten mindestens 62,5 % und die Wertpapierleihstelle bis zu 37,5 % dieses Ertrags, wobei sämtliche operativen Kosten aus dem Anteil des Vermittlers der Wertpapierleihe getragen werden. Die im Geschäftsjahr aus Wertpapierleihtransaktionen erzielten Erträge werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen unter der Rubrik „Wertpapierleihe“ ausgewiesen.

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Die folgende Tabelle gibt den Wert der verliehenen Wertpapiere (einzeln in der Vermögensaufstellung der entsprechenden Fonds aufgeführt), analysiert nach Kontrahent, zum 31. Mai 2023 an.

| Gegenpartei | Sitz der Gegenpartei | Verliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten |
|---|--------------------------------|--------------------|------------------------|
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | | |
| BNP Paribas | Frankreich | 1.331.826 | 2.063.073 |
| JP Morgan | Großbritannien | 388.004 | 429.275 |
| Gesamt | | 1.719.830 | 2.492.348 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 381.326 | 432.523 |
| BNP Paribas | Frankreich | 14.174.747 | 15.710.525 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 824.137 | 875.164 |
| HSBC | Großbritannien | 6.247.769 | 6.755.674 |
| JP Morgan | Großbritannien | 4.802.092 | 5.312.878 |
| UBS | Schweiz | 3.293.459 | 4.099.857 |
| Gesamt | | 29.723.530 | 33.186.621 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 240.462 | 272.748 |
| BNP Paribas | Frankreich | 242.891 | 269.208 |
| JP Morgan | Großbritannien | 1.812.356 | 2.005.132 |
| UBS | Schweiz | 5.996.721 | 7.465.008 |
| Gesamt | | 8.292.430 | 10.012.096 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 22.045.234 | 23.020.676 |
| BNP Paribas | Frankreich | 8.739.074 | 9.210.409 |
| Deutsche Bank | Deutschland | 2.096.774 | 2.187.918 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.850.628 | 1.929.643 |
| JP Morgan | Großbritannien | 39.729.514 | 50.358.689 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 14.374.862 | 14.964.642 |
| Nomura International | Großbritannien | 17.131.940 | 18.797.014 |
| Zürcher Kantonalbank | Schweiz | 1.737.042 | 1.927.726 |
| Gesamt | | 107.705.068 | 122.396.717 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 286.495 | 299.172 |
| BNP Paribas | Frankreich | 204.969 | 215.963 |
| JP Morgan | Großbritannien | 1.213.169 | 1.304.067 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 634.284 | 660.307 |
| Gesamt | | 2.338.917 | 2.479.509 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 12.535.591 | 14.218.620 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 910.533 | 966.909 |
| HSBC | Großbritannien | 397.190 | 429.479 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.421.698 | 1.503.564 |
| UBS | Schweiz | 1.337.752 | 1.665.298 |
| Gesamt | | 16.602.764 | 18.783.870 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 424.357 | 481.331 |
| BNP Paribas | Frankreich | 15.135.548 | 16.775.426 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 7.660.298 | 8.134.596 |
| HSBC | Großbritannien | 1.093.107 | 1.181.970 |
| JP Morgan | Großbritannien | 4.398.422 | 4.866.270 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 2.046.701 | 2.164.557 |
| Societe Generale | Frankreich | 9.717.336 | 10.825.822 |
| UBS | Schweiz | 3.106.737 | 3.867.416 |
| Gesamt | | 43.582.506 | 48.297.388 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Gegenpartei | Sitz der Gegenpartei | Verliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten |
|--|--------------------------------|--------------------|------------------------|
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 3.124.389 | 3.262.634 |
| BNP Paribas | Frankreich | 6.572.511 | 7.128.785 |
| Citibank | Großbritannien | 337.007 | 363.022 |
| Deutsche Bank | Deutschland | 484.426 | 505.483 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.399.002 | 1.458.735 |
| HSBC | Großbritannien | 2.907.195 | 3.182.915 |
| JP Morgan | Großbritannien | 5.897.080 | 6.287.425 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 691.770 | 723.120 |
| Societe Generale | Frankreich | 4.189.997 | 4.427.188 |
| UBS | Schweiz | 663.780 | 817.241 |
| Gesamt | | 26.267.157 | 28.156.548 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund (in EUR) | | | |
| HSBC | Großbritannien | 646.477 | 699.032 |
| Societe Generale | Frankreich | 28.380 | 31.618 |
| Gesamt | | 674.857 | 730.650 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | | |
| BNP Paribas | Frankreich | 469.476 | 514.159 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 186.925 | 194.906 |
| Gesamt | | 656.401 | 709.065 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 50.387.837 | 55.604.492 |
| BNP Paribas | Frankreich | 4.047.477 | 4.264.578 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 2.170.625 | 2.263.305 |
| HSBC | Großbritannien | 1.347.281 | 1.456.807 |
| JP Morgan | Großbritannien | 14.903.634 | 16.170.217 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 25.724.693 | 27.206.006 |
| UBS | Schweiz | 31.408.524 | 39.098.843 |
| Gesamt | | 129.990.071 | 146.064.248 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 17.981.147 | 19.891.549 |
| BNP Paribas | Frankreich | 525.907 | 582.887 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 3.484.390 | 3.700.130 |
| HSBC | Großbritannien | 10.096.124 | 10.916.877 |
| JP Morgan | Großbritannien | 865.590 | 957.660 |
| Macquarie Bank | Australien | 6.161.548 | 6.864.701 |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 912.160 | 1.069.943 |
| UBS | Schweiz | 15.042.415 | 18.725.522 |
| Gesamt | | 55.069.281 | 62.709.269 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (in EUR) | | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 44.692 | 65.933 |
| Gesamt | | 44.692 | 65.933 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (in EUR) | | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 5.302.683 | 7.822.952 |
| Gesamt | | 5.302.683 | 7.822.952 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (in EUR) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 28.020 | 31.783 |
| JP Morgan | Großbritannien | 21.163.661 | 23.414.786 |
| Gesamt | | 21.191.681 | 23.446.569 |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (in EUR) | | | |
| Banco Santander | Spanien | 5.969.901 | 6.729.558 |
| Barclays Bank | Großbritannien | 4.490.390 | 4.689.076 |
| BNP Paribas | Frankreich | 1.981.898 | 2.088.204 |
| Citibank | Großbritannien | 5.765.619 | 7.664.276 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.527.708 | 4.721.025 |
| JP Morgan | Großbritannien | 19.313.687 | 20.720.090 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 9.635.205 | 10.030.373 |
| Natixis | Frankreich | 573.724 | 629.463 |
| RBC Europe Limited | Großbritannien | Entfällt | 529.172 |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 33.668.133 | 37.243.343 |
| Gesamt | | 85.926.265 | 95.044.580 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Gegenpartei | Sitz der Gegenpartei | Verliehener Betrag | Erhaltene Sicherheiten |
|---|--------------------------------|--------------------|------------------------|
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 6.408.566 | 6.692.127 |
| BNP Paribas | Frankreich | 1.680.562 | 2.145.693 |
| Deutsche Bank | Deutschland | 589.559 | 615.187 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.111.316 | 4.286.856 |
| JP Morgan | Großbritannien | 2.043.504 | 2.203.300 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.455.384 | 1.515.096 |
| Societe Generale | Frankreich | 667.907 | 704.108 |
| Gesamt | | 16.956.798 | 18.162.367 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 556.780 | 581.415 |
| JP Morgan | Großbritannien | 2.884.968 | 3.074.402 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.024.175 | 4.189.162 |
| Gesamt | | 7.465.923 | 7.844.979 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 3.593.224 | 3.752.215 |
| BNP Paribas | Frankreich | 1.391.343 | 1.465.972 |
| Deutsche Bank | Deutschland | 413.412 | 431.382 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 5.824.524 | 6.073.212 |
| JP Morgan | Großbritannien | 7.106.028 | 8.823.219 |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 456.724 | 505.224 |
| Gesamt | | 18.785.255 | 21.051.224 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | |
| Banco Santander | Spanien | 15.297.208 | 17.003.326 |
| Barclays Bank | Großbritannien | 31.188.457 | 33.578.758 |
| BNP Paribas | Frankreich | 4.998.507 | 5.266.620 |
| Citibank | Großbritannien | 24.083.855 | 30.788.492 |
| Credit Suisse | Irland | 169.961 | 241.141 |
| Deutsche Bank | Deutschland | 2.210.822 | 2.306.924 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.792.028 | 3.694.074 |
| JP Morgan | Großbritannien | 43.913.697 | 46.961.411 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 6.020.114 | 6.267.110 |
| Nomura International | Großbritannien | 3.654.120 | 7.474.845 |
| RBC Europe Limited | Großbritannien | 1.315.122 | 1.399.991 |
| Zürcher Kantonalbank | Schweiz | 18.092.555 | 20.078.679 |
| Gesamt | | 152.736.446 | 175.061.371 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 898.205 | 1.325.107 |
| Barclays Bank | Großbritannien | 2.833.922 | 3.214.404 |
| BNP Paribas | Frankreich | 8.052.029 | 12.405.227 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 2.318.694 | 2.462.259 |
| HSBC | Großbritannien | 384.616 | 415.882 |
| JP Morgan | Großbritannien | 123.249 | 136.359 |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | 364.894 | 428.012 |
| UBS | Schweiz | 1.776.009 | 2.210.862 |
| Gesamt | | 16.751.618 | 22.598.112 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund (in USD) | | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 1.453.102 | 1.648.196 |
| BNP Paribas | Frankreich | 231.632 | 256.728 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 1.947.903 | 2.068.510 |
| HSBC | Großbritannien | 438.061 | 473.673 |
| JP Morgan | Großbritannien | 870.390 | 1.338.665 |
| Societe Generale | Frankreich | 313.916 | 349.726 |
| UBS | Schweiz | 1.006.331 | 1.252.730 |
| Gesamt | | 6.261.335 | 7.388.228 |

Alle verliehenen Wertpapiere haben eine offene Laufzeit, da sie täglich zurückgefordert oder gekündigt werden können.

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Total return swaps (einschließlich CFDs)

Sämtliche Geschäfte mit TRS (einschließlich CFDs) gehen die Fonds gemäß einer Mastervereinbarung der International Swaps and Derivatives Associations, Inc. („ISDA-Mastervereinbarung“) oder einer ähnlichen Vereinbarung ein. Eine ISDA-Mastervereinbarung ist eine zweiseitige Vereinbarung zwischen den Fonds und einem Kontrahenten, welche OTC-FDI-Transaktionen (einschließlich TRS und CFDs) regelt, die die Parteien eingehen. Die Engagements der Parteien gemäß der ISDA-Mastervereinbarung werden saldiert und besichert. Daher beziehen sich alle Angaben zu Sicherheiten auf alle von den Fonds gemäß der ISDA-Mastervereinbarung eingegangenen OTC-FD-Transaktionen, und nicht nur auf TRS und CFDs.

Sämtliche von den Fonds gemäß der ISDA-Mastervereinbarung entgegengenommenen/gestellten Sicherheiten werden gemäß einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung bilateral übertragen.

Die vom BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, vom BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, vom Systematic Style Factor Fund und vom BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund im Rahmen der ISDA-Mastervereinbarungen in Bezug auf Schwankungsmargen erhaltenen/gestellten Sicherheiten werden gemäß einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung bilateral übertragen. Die von den Fonds in Bezug auf Schwankungsmargen erhaltenen Sicherheiten werden auf einem Konto im Namen der Verwahrstelle im Auftrag der Fonds gehalten. Die erhaltenen Sicherheiten werden von dem Vermögen der Verwahrstelle der Fonds getrennt. Die vom Fonds gemäß dem ISDA-Rahmenvertrag gestellten Sicherheiten, die den unabhängigen Betrag (manchmal als Ersteinschuss bezeichnet) darstellen, werden vom Fonds im Rahmen einer Sicherungsrechtsvereinbarung gestellt.

Die folgende Tabelle gibt den Wert der Total Return Swaps (einschließlich CFDs) als Anteil des NIW des Fonds zum 31. Mai 2023 und die im zum 31. Mai 2023 endenden Geschäftsjahr erzielten Erträge/Renditen an. Der Wert der Total Return Swaps (einschließlich CFDs) basiert auf dem zugrunde liegenden Positionswert auf absoluter Bruttowertbasis.

| Fonds | Währung | TRS (einschließlich CFDs) | |
|---|---------|---------------------------|------------------------|
| | | % des NIW | Erzielte Gesamtrendite |
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund | USD | 650,18 % | 2.205.014 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund | USD | 84,55 % | 3.915.837 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund | USD | 476,54 % | 4.921.864 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund | EUR | 15,44 % | 3.493.332 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund | GBP | 119,88 % | 25.290.911 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund | USD | 65,74 % | 13.463.743 |
| BlackRock European Absolute Return Fund | EUR | 63,95 % | 30.143.761 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund | EUR | 46,73 % | 15.686.489 |
| BlackRock European Select Strategies Fund | EUR | 1,53 % | 108.480 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund | EUR | 8,00 % | (106.141) |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund | USD | 64,14 % | 2.122.869 |
| BlackRock Global Event Driven Fund | USD | 43,92 % | (100.512.451) |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund | USD | 1,35 % | 715.053 |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund | USD | 245,96 % | 3.915.146 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund | EUR | 1,44 % | (153.313) |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund | EUR | 0,10 % | 29.390 |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund | USD | 484,16 % | 82.204 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund | GBP | 108,39 % | 19.042.055 |

Die aus Total Return Swaps (einschließlich CFDs) erzielten Gesamtrenditen werden auf der Grundlage der Gesamtrendite dargestellt, einschließlich der damit verbundenen Zins- und Dividendenerträge oder -aufwendungen und Nettogewinne/-verluste aus Preisbewegungen des beizulegenden Zeitwerts. Sämtliche Erträge und Kosten aus Total Return Swaps (einschließlich CFDs) fließen an die Fonds und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen oder Kosten mit der Verwaltungsgesellschaft des Fonds oder Dritten.

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

In der folgenden Tabelle ist der Wert der zugrunde liegenden Risikoposition für Total Return Swaps (einschließlich CFDs) dargestellt, analysiert nach Kontrahent per 31. Mai 2023.

| Gegenpartei | Sitz der Gegenpartei | Zugrunde liegendes Exposure 31. Mai 2023 |
|---|--------------------------------|--|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund (in USD) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 450.295.398 |
| Barclays Bank | Großbritannien | 1.462.273.050 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 906.275.038 |
| HSBC | Großbritannien | 894.437.758 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 765.617.025 |
| Gesamt | | 4.478.898.269 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 11.475.293 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 8.237.547 |
| JP Morgan | Großbritannien | 19.746.093 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 24.464.956 |
| Gesamt | | 63.923.889 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund (in USD) | | |
| Citibank | Großbritannien | 78.676.538 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 2.966.950 |
| HSBC | Großbritannien | 41.133.080 |
| JP Morgan | Großbritannien | 84.721.561 |
| Gesamt | | 207.498.129 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 7.486.985 |
| Citibank | Großbritannien | 20.462.975 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 13.630.445 |
| HSBC | Großbritannien | 29.265.633 |
| JP Morgan | Großbritannien | 26.891.695 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.464.224 |
| UBS | Schweiz | 18.853.475 |
| Gesamt | | 121.055.432 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (in GBP) | | |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 152.732.039 |
| HSBC | Großbritannien | 122.819.763 |
| JP Morgan | Großbritannien | 97.442.466 |
| Societe Generale | Frankreich | 39.332.554 |
| Gesamt | | 412.326.822 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 92.633.973 |
| BNP Paribas | Frankreich | 3.654.989 |
| Citibank | Großbritannien | 19.290.553 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 71.753.642 |
| HSBC | Großbritannien | 80.063.418 |
| JP Morgan | Großbritannien | 16.775.814 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 7.313.350 |
| UBS | Schweiz | 2.602.441 |
| Gesamt | | 294.088.180 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 148.209.655 |
| Barclays Bank | Großbritannien | 253.657.535 |
| BNP Paribas | Frankreich | 60.112.090 |
| Citibank | Großbritannien | 156.145.417 |
| JP Morgan | Großbritannien | 255.458.716 |
| Gesamt | | 873.583.413 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Gegenpartei | Sitz der Gegenpartei | Zugrunde liegendes Exposure 31. Mai 2023 |
|---|--------------------------------|---|
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 72.927.761 |
| Barclays Bank | Großbritannien | 70.125.025 |
| BNP Paribas | Frankreich | 20.963.195 |
| Citibank | Großbritannien | 59.967.786 |
| JP Morgan | Großbritannien | 59.098.296 |
| Gesamt | | 283.082.063 |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 4.788.957 |
| Gesamt | | 4.788.957 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | |
| BNP Paribas | Frankreich | 2.200.395 |
| HSBC | Großbritannien | 10.757 |
| JP Morgan | Großbritannien | 5.428.366 |
| Gesamt | | 7.639.518 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 7.958.420 |
| JP Morgan | Großbritannien | 4.541.979 |
| UBS | Schweiz | 9.347.885 |
| Gesamt | | 21.848.284 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | |
| Barclays Bank | Großbritannien | 74.632.873 |
| BNP Paribas | Frankreich | 10.496.483 |
| Citibank | Großbritannien | 115.715.982 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 161.483.062 |
| JP Morgan | Großbritannien | 757.637.099 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 367.297.306 |
| Societe Generale | Frankreich | 23.545.060 |
| Gesamt | | 1.510.807.865 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 13.143.620 |
| Gesamt | | 13.143.620 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (in EUR) | | |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund (in USD) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 43.489.793 |
| Barclays Bank | Großbritannien | 64.704.213 |
| BNP Paribas | Frankreich | 71.338.976 |
| Citibank | Großbritannien | 23.387.122 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 50.398.927 |
| HSBC | Großbritannien | 27.608.295 |
| JP Morgan | Großbritannien | 13.480.994 |
| Gesamt | | 294.408.320 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 3.780.097 |
| Gesamt | | 3.780.097 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | |
| JP Morgan | Großbritannien | 2.826.715 |
| Gesamt | | 2.826.715 |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | |
| Bank of America Merrill Lynch | Vereinigte Staaten von Amerika | 54.169.157 |
| Goldman Sachs | Vereinigte Staaten von Amerika | 69.128.468 |
| Morgan Stanley | Vereinigte Staaten von Amerika | 53.897.253 |
| Gesamt | | 177.194.878 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (in GBP) | | |
| BNP Paribas | Frankreich | 7.654.293 |
| HSBC | Großbritannien | 90.431.040 |
| JP Morgan | Großbritannien | 99.588.712 |
| Societe Generale | Frankreich | 13.442.310 |
| Gesamt | | 211.116.355 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse der Laufzeit von TRS (einschließlich CFDs) zum 31. Mai 2023:

| | Laufzeit | | | | | | Offene Transaktionen | Gesamt |
|---|----------|--------------|---------------|----------------|-----------------|---------------|----------------------|---------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 4.478.898.269 | 4.478.898.269 |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 63.923.889 | 63.923.889 |
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 207.498.129 | 207.498.129 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | 23.317.699 | 97.737.733 | - | - | 121.055.432 |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (in GBP) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 412.326.822 | 412.326.822 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 294.088.180 | 294.088.180 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 873.583.413 | 873.583.413 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 283.082.063 | 283.082.063 |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 4.788.957 | 4.788.957 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | 7.628.761 | - | - | - | 10.757 | 7.639.518 |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 21.848.284 | 21.848.284 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 1.510.807.865 | 1.510.807.865 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 13.143.620 | 13.143.620 |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | 19.419.133 | - | - | - | 274.989.187 | 294.408.320 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 3.780.097 | 3.780.097 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | 2.826.715 | - | 2.826.715 |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 177.194.878 | 177.194.878 |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (in GBP) | | | | | | | | |
| TRS (einschließlich CFDs) | - | - | - | - | - | - | 211.116.355 | 211.116.355 |

Die vorstehende Laufzeitendarstellung basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der jeweiligen Transaktion. Offene Transaktionen sind Transaktionen, die täglich zurückgefordert oder gekündigt werden können, und CFD beinhalten.

Analyse der Währung der Sicherheiten

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse nach Währung der von den Fonds mittels einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung erhaltenen/ gestellten Bar- und unbaren Sicherheiten hinsichtlich der Wertpapierleihttransaktionen und OTC-FD (einschließlich TRS und CFDs) zum 31. Mai 2023.

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Erhaltene unbare Sicherheiten | Gestellte unbare Sicherheiten |
|---|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| BlackRock Systematic US Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 31.575.500 | - | - |
| Gesamt | - | 31.575.500 | - | - |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 14.143 | - |
| CHF | - | - | 29.948 | - |
| GBP | - | - | 213.177 | - |
| JPY | - | - | 30.940 | - |
| USD | - | - | 2.204.140 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 3.182.300 | - | - | - |
| Gesamt | 3.182.300 | - | 2.492.348 | - |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Erhaltene unbare Sicherheiten | Gestellte unbare Sicherheiten |
|---|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 1.300.000 | 260.000 | - | - |
| Gesamt | 1.300.000 | 260.000 | - | - |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 3.275.749 | - |
| CAD | - | - | 188.389 | - |
| CHF | - | - | 377.722 | - |
| DKK | - | - | 73 | - |
| EUR | - | - | 2.271.321 | - |
| GBP | - | - | 4.386.162 | - |
| JPY | - | - | 516.714 | - |
| NOK | - | - | 3.761 | - |
| SEK | - | - | 48.553 | - |
| USD | - | - | 22.118.177 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 3.520.000 | - | - | - |
| Gesamt | 3.520.000 | - | 33.186.621 | - |
| BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (in GBP) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 6.630.000 | - | - | - |
| Gesamt | 6.630.000 | - | - | - |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 5.964.473 | - |
| CAD | - | - | 90.374 | - |
| CHF | - | - | 141.314 | - |
| EUR | - | - | 314.511 | - |
| GBP | - | - | 1.531.192 | - |
| JPY | - | - | 325.388 | - |
| NOK | - | - | 2.331 | - |
| SEK | - | - | 30.469 | - |
| USD | - | - | 1.612.044 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 8.008.000 | 4.090.000 | - | - |
| Gesamt | 8.008.000 | 4.090.000 | 10.012.096 | - |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 3.794.779 | - |
| CHF | - | - | 193.293 | - |
| DKK | - | - | 40 | - |
| EUR | - | - | 60.346.352 | - |
| GBP | 149.548 | - | 11.467.967 | - |
| JPY | - | - | 745.785 | - |
| USD | - | - | 45.698.953 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 9.490.000 | 17.103.000 | - | - |
| Gesamt | 9.639.548 | 17.103.000 | 122.247.169 | - |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 102.944 | - |
| EUR | - | - | 1.124.430 | - |
| GBP | 3.507 | - | 245.438 | - |
| JPY | - | - | 90.672 | - |
| USD | - | - | 912.518 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 2.114.000 | - | 35.399.797 |
| Gesamt | 3.507 | 2.114.000 | 2.476.002 | 35.399.797 |

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Erhaltene unbare Sicherheiten | Gestellte unbare Sicherheiten |
|---|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 1.330.558 | - |
| CAD | - | - | 5.424 | - |
| CHF | - | - | 823 | - |
| DKK | - | - | 5 | - |
| EUR | - | - | 11.235.076 | - |
| GBP | - | - | 3.125.776 | - |
| JPY | - | - | 78.409 | - |
| NOK | - | - | 121.517 | - |
| SEK | - | - | 1.588.375 | - |
| USD | - | - | 1.297.907 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 8.214.700 | 3.240.000 | - | - |
| Gesamt | 8.214.700 | 3.240.000 | 18.783.870 | - |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 3.090.030 | - |
| CAD | - | - | 1.383.374 | - |
| CHF | - | - | 1.386.922 | - |
| DKK | - | - | 13 | - |
| EUR | - | - | 6.625.469 | - |
| GBP | - | - | 6.508.764 | - |
| JPY | - | - | 2.344.110 | - |
| NOK | - | - | 4.124 | - |
| SEK | - | - | 1.035.975 | - |
| USD | - | - | 25.918.607 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 1.904.500 | 1.640.000 | - | - |
| Gesamt | 1.904.500 | 1.640.000 | 48.297.388 | - |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 460.295 | - |
| CAD | - | - | 51.572 | - |
| CHF | - | - | 20.911 | - |
| DKK | - | - | 69.625 | - |
| EUR | - | - | 13.262.718 | - |
| GBP | 93.118 | - | 2.367.330 | - |
| JPY | - | - | 66.640 | - |
| NOK | - | - | 69.618 | - |
| SEK | - | - | 17.141 | - |
| USD | - | - | 11.677.580 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 1.540.000 | - | - |
| Gesamt | 93.118 | 1.540.000 | 28.063.430 | - |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 3.535 | - |
| CHF | - | - | 3.690 | - |
| DKK | - | - | 8 | - |
| EUR | - | - | 169.607 | - |
| GBP | - | - | 127.349 | - |
| JPY | - | - | 4.614 | - |
| NOK | - | - | 7 | - |
| SEK | - | - | 2.892 | - |
| USD | - | - | 418.948 | - |
| Gesamt | - | - | 730.650 | - |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Erhaltene unbare Sicherheiten | Gestellte unbare Sicherheiten |
|--|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | | | |
| EUR | - | - | 161.300 | - |
| GBP | 1.934 | - | 58.233 | - |
| USD | - | - | 487.598 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 90.000 | 5.363.000 | - | - |
| Gesamt | 91.934 | 5.363.000 | 707.131 | - |
| BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 405.000 | - | - | - |
| Gesamt | 405.000 | - | - | - |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 31.239.607 | - |
| CAD | - | - | 385.212 | - |
| CHF | - | - | 554.834 | - |
| DKK | - | - | 16 | - |
| EUR | - | - | 21.452.901 | - |
| GBP | 69.243 | - | 13.133.999 | - |
| JPY | - | - | 1.511.449 | - |
| NOK | - | - | 14 | - |
| SEK | - | - | 51 | - |
| USD | - | - | 77.716.922 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 6.500.500 | 89.614.425 | 2.169.375.389 | 3.980.230.169 |
| Gesamt | 6.569.743 | 89.614.425 | 2.315.370.394 | 3.980.230.169 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 14.961.513 | - |
| CAD | - | - | 92.541 | - |
| CHF | - | - | 80.795 | - |
| DKK | - | - | 119 | - |
| EUR | - | - | 5.308.371 | - |
| GBP | - | - | 4.636.824 | - |
| JPY | - | - | 668.382 | - |
| NOK | - | - | 6.048 | - |
| SEK | - | - | 78.081 | - |
| USD | - | - | 36.876.595 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 3.464.712 | - | - |
| Gesamt | - | 3.464.712 | 62.709.269 | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 11.927 | - |
| EUR | - | - | 47.723 | - |
| USD | - | - | 6.283 | - |
| Gesamt | - | - | 65.933 | - |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 1.415.190 | - |
| EUR | - | - | 5.662.290 | - |
| USD | - | - | 745.472 | - |
| Gesamt | - | - | 7.822.952 | - |

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Erhaltene unbare Sicherheiten | Gestellte unbare Sicherheiten |
|---|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 771.416 | - |
| CHF | - | - | 1.633.576 | - |
| EUR | - | - | 22.511 | - |
| GBP | - | - | 11.633.161 | - |
| JPY | - | - | 1.687.638 | - |
| NOK | - | - | 272 | - |
| SEK | - | - | 3.550 | - |
| USD | - | - | 7.694.445 | - |
| Gesamt | - | - | 23.446.569 | - |
| BlackRock Systematic Style Factor Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 719.500 | 1.533.000 | - | - |
| Gesamt | 719.500 | 1.533.000 | - | - |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 57.916 | - |
| CAD | - | - | 536.361 | - |
| CHF | - | - | 789.864 | - |
| DKK | - | - | 1.462.324 | - |
| EUR | - | - | 26.809.048 | - |
| GBP | 33.906 | - | 39.439.684 | - |
| JPY | - | - | 729.875 | - |
| NOK | - | - | 1.568.808 | - |
| SEK | - | - | 183.028 | - |
| USD | - | - | 23.433.766 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 1.099.000 | - | - |
| Gesamt | 33.906 | 1.099.000 | 95.010.674 | - |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 234.613 | - |
| EUR | - | - | 9.865.730 | - |
| GBP | 34.839 | - | 2.800.543 | - |
| JPY | - | - | 206.667 | - |
| USD | - | - | 5.019.975 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 1.189.000 | - | - |
| Gesamt | 34.839 | 1.189.000 | 18.127.528 | - |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | | | | |
| EUR | - | - | 4.133.134 | - |
| GBP | - | - | 882.865 | - |
| USD | - | - | 2.828.980 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 194.000 | - | - |
| Gesamt | - | 194.000 | 7.844.979 | - |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten | Erhaltene unbare Sicherheiten | Gestellte unbare Sicherheiten |
|---|---------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 1.412.361 | - |
| CHF | - | - | 7.620 | - |
| EUR | - | - | 8.804.226 | - |
| GBP | 23.803 | - | 2.941.348 | - |
| JPY | - | - | 1.243.684 | - |
| USD | - | - | 6.618.182 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 4.579.000 | - | - |
| Gesamt | 23.803 | 4.579.000 | 21.027.421 | - |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| CAD | - | - | 2.881.962 | - |
| CHF | - | - | 2.270 | - |
| DKK | - | - | 5.879.113 | - |
| EUR | - | - | 79.729.936 | - |
| GBP | 86.269 | - | 10.777.761 | - |
| JPY | - | - | 4.815.971 | - |
| NOK | - | - | 6.251.402 | - |
| SEK | - | - | 1.839.052 | - |
| USD | - | - | 62.797.635 | - |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 2.154.000 | 63.572.400 | - | 501.736.866 |
| Gesamt | 2.240.269 | 63.572.400 | 174.975.102 | 501.736.866 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 1.766.458 | - |
| CAD | - | - | 251.409 | - |
| CHF | - | - | 10.602 | - |
| DKK | - | - | 5 | - |
| EUR | - | - | 4.258.576 | - |
| GBP | - | - | 1.424.677 | - |
| JPY | - | - | 160.321 | - |
| NOK | - | - | 27.475 | - |
| SEK | - | - | 359.095 | - |
| USD | - | - | 14.339.494 | - |
| Gesamt | - | - | 22.598.112 | - |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund (in USD) | | | | |
| Wertpapierleihe-Transaktionen | | | | |
| AUD | - | - | 1.000.920 | - |
| CAD | - | - | 87.287 | - |
| CHF | - | - | 128.054 | - |
| DKK | - | - | 5 | - |
| EUR | - | - | 2.111.027 | - |
| GBP | - | - | 1.646.013 | - |
| JPY | - | - | 259.287 | - |
| NOK | - | - | 14.090 | - |
| SEK | - | - | 215.865 | - |
| USD | - | - | 1.925.680 | - |
| Gesamt | - | - | 7.388.228 | - |
| BlackRock Systematic Global Equity Absolute Return Fund (in USD) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | - | 413.000 | - | - |
| Gesamt | - | 413.000 | - | - |
| BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (in GBP) | | | | |
| OTC-Derivate-Transaktionen | | | | |
| | 2.490.000 | - | - | - |
| Gesamt | 2.490.000 | - | - | - |

Am 31. Mai 2023 war ein Teil der von den Fonds erhaltenen Barsicherheiten in Geldmarktfonds reinvestiert, die, wie im Anlageportfolio der Fonds aufgeführt, von den verbundenen Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Die Fonds sind die rechtlichen Eigentümer der entgegengenommenen Sicherheiten und können die Vermögenswerte verkaufen und die Barmittel im Falle eines Ausfalls einbehalten. Sämtliche als Sicherheit entgegengenommenen oder gestellten Barmittel haben eine offene Laufzeit, da sie keinem vertraglichen Fälligkeitsdatum unterliegen.

Unbare Sicherheiten, die auf der Grundlage einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung in Verbindung mit Wertpapierleihgeschäften und OTC-FDI-Transaktionen entgegengenommen werden, können nicht verkauft, wiederangelegt oder verpfändet werden.

Die im Verlauf des Geschäftsjahres bis zum 31. Mai 2023 von den Fonds erzielten Erträge aus der Wiederanlage von Barsicherheiten in Geldmarktfonds werden nachstehend zusammengefasst. Diese Erträge stellen die akkumulierten Gesamterträge des jeweiligen Geldmarktfonds für das zum 31. Mai 2023 endende Jahr dar. In diesen Beträgen sind etwaige Zinsverbindlichkeiten gegenüber dem Kontrahenten gemäß den entsprechenden Sicherheitenvereinbarungen nicht berücksichtigt.

| Geldmarktfonds | Gesamterträge |
|--|---------------|
| Institutional Cash Series plc | |
| - Institutional Euro Liquidity Fund | 0,94 % |
| - Institutional GBP Liquidity Fund | 2,58 % |
| - Institutional US Dollar Liquidity Fund | 3,20 % |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Analyse von Art, Qualität und Laufzeit der Sicherheiten

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art, Qualität und Laufzeit der unbaren Sicherheiten, welche die Fonds auf der Grundlage einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung in Verbindung mit Wertpapierleihtransaktionen entgegengenommen haben. Stand: 31. Mai 2023.

| Art und Qualität der Sicherheit | Laufzeit | | | | | | Offen | Gesamt |
|---|----------|--------------|----------------|----------------|------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | - | 204 | - | 204 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 2.492.144 | 2.492.144 |
| Gesamt | - | - | - | - | - | 204 | 2.492.144 | 2.492.348 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 78.269 | 4.712.665 | - | 4.790.934 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 28.395.687 | 28.395.687 |
| Gesamt | - | - | - | - | 78.269 | 4.712.665 | 28.395.687 | 33.186.621 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 49.354 | 259.096 | - | 308.450 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 9.703.646 | 9.703.646 |
| Gesamt | - | - | - | - | 49.354 | 259.096 | 9.703.646 | 10.012.096 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 39.118 | 2.227 | 2.161.085 | 114.660.689 | - | 116.863.119 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 5.384.050 | 5.384.050 |
| Gesamt | - | - | 39.118 | 2.227 | 2.161.085 | 114.660.689 | 5.384.050 | 122.247.169 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 8.028 | 2.170.882 | - | 2.178.910 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 297.092 | 297.092 |
| Gesamt | - | - | - | - | 8.028 | 2.170.882 | 297.092 | 2.476.002 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 229.503 | 39.057 | 2.844.966 | 13.767.390 | - | 16.880.916 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 1.902.954 | 1.902.954 |
| Gesamt | - | - | 229.503 | 39.057 | 2.844.966 | 13.767.390 | 1.902.954 | 18.783.870 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 330.397 | 56.227 | 478.780 | 10.225.891 | - | 11.091.295 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 37.206.093 | 37.206.093 |
| Gesamt | - | - | 330.397 | 56.227 | 478.780 | 10.225.891 | 37.206.093 | 48.297.388 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Art und Qualität der Sicherheit | Laufzeit | | | | | | Offen | Gesamt |
|--|----------|--------------|------------------|----------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 58.510 | 151.759 | 596.773 | 21.669.666 | - | 22.476.708 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 5.586.722 | 5.586.722 |
| Gesamt | - | - | 58.510 | 151.759 | 596.773 | 21.669.666 | 5.586.722 | 28.063.430 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | - | 361.761 | - | 361.761 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 368.889 | 368.889 |
| Gesamt | - | - | - | - | - | 361.761 | 368.889 | 730.650 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 3.951 | 225 | 52.866 | 255.008 | - | 312.050 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 395.081 | 395.081 |
| Gesamt | - | - | 3.951 | 225 | 52.866 | 255.008 | 395.081 | 707.131 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 4.198.590 | 709.316 | 5.643.948 | 35.781.118 | - | 46.332.972 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 99.662.033 | 99.662.033 |
| Gesamt | - | - | 4.198.590 | 709.316 | 5.643.948 | 35.781.118 | 99.662.033 | 145.995.005 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 125.832 | 10.533.931 | - | 10.659.763 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 52.049.506 | 52.049.506 |
| Gesamt | - | - | - | - | 125.832 | 10.533.931 | 52.049.506 | 62.709.269 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 18.210 | 47.723 | - | 65.933 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Gesamt | - | - | - | - | 18.210 | 47.723 | - | 65.933 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 2.160.662 | 5.662.290 | - | 7.822.952 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Gesamt | - | - | - | - | 2.160.662 | 5.662.290 | - | 7.822.952 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 5.751 | 37.172 | - | 42.923 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 23.403.646 | 23.403.646 |
| Gesamt | - | - | - | - | 5.751 | 37.172 | 23.403.646 | 23.446.569 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Art und Qualität der Sicherheit | Laufzeit | | | | | | Offen | Gesamt |
|---|----------|--------------|----------------|----------------|------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 95.705 | 5.449 | 1.429.179 | 46.928.992 | - | 48.459.325 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 46.551.349 | 46.551.349 |
| Gesamt | - | - | 95.705 | 5.449 | 1.429.179 | 46.928.992 | 46.551.349 | 95.010.674 |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 86.903 | 29.056 | 1.173.383 | 16.161.087 | - | 17.450.429 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 677.099 | 677.099 |
| Gesamt | - | - | 86.903 | 29.056 | 1.173.383 | 16.161.087 | 677.099 | 18.127.528 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | - | 7.844.979 | - | 7.844.979 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Gesamt | - | - | - | - | - | 7.844.979 | - | 7.844.979 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 123.116 | 7.009 | 1.563.886 | 14.752.522 | - | 16.446.533 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 4.580.888 | 4.580.888 |
| Gesamt | - | - | 123.116 | 7.009 | 1.563.886 | 14.752.522 | 4.580.888 | 21.027.421 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | 74.889 | 4.263 | 4.589.492 | 128.883.658 | - | 133.552.302 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 41.422.800 | 41.422.800 |
| Gesamt | - | - | 74.889 | 4.263 | 4.589.492 | 128.883.658 | 41.422.800 | 174.975.102 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 947.642 | 6.182.498 | - | 7.130.140 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 15.467.972 | 15.467.972 |
| Gesamt | - | - | - | - | 947.642 | 6.182.498 | 15.467.972 | 22.598.112 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Entgegengenommene Sicherheiten - Wertpapierleihe | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 298.245 | 3.588.394 | - | 3.886.639 |
| Aktien | | | | | | | | |
| Anerkannter Aktienindex | - | - | - | - | - | - | 3.501.589 | 3.501.589 |
| Gesamt | - | - | - | - | 298.245 | 3.588.394 | 3.501.589 | 7.388.228 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art, Qualität und Laufzeit der unbaren Sicherheiten, welche die Fonds auf der Grundlage einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung in Verbindung mit OTC-FDIs erhalten/gestellt haben. Stand: 31. Mai 2023.

| Art und Qualität der Sicherheit | Laufzeit | | | | | | Offene Transaktionen | Gesamt |
|---|----------|--------------|---------------|--------------------|----------------------|--------------------|----------------------|----------------------|
| | 1 Tag | 2 bis 7 Tage | 8 bis 30 Tage | 31 bis 90 Tage | 91 bis 365 Tage | Über 365 Tage | | |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | 35.399.797 | - | - | 35.399.797 |
| Gesamt | - | - | - | - | 35.399.797 | - | - | 35.399.797 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | 502.950.136 | 3.477.280.034 | - | - | 3.980.230.170 |
| Gesamt | - | - | - | 502.950.136 | 3.477.280.034 | - | - | 3.980.230.170 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | | | | | | | | |
| Festverzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | |
| Investment-Grade | - | - | - | - | - | 501.736.866 | - | 501.736.866 |
| Gesamt | - | - | - | - | - | 501.736.866 | - | 501.736.866 |

Investment-Grade-Sicherheiten werden von einer Stelle ausgegeben, die von mindestens einer der weltweit anerkannten Rating-Agenturen (Standard & Poor's, Moody's oder Fitch) eine Mindestbonität erhalten hat.

Ein anerkannter Aktienindex enthält mindestens 20 Aktien, von denen keine mehr als 20 % des Gesamtindex darstellt und in dem keine fünf Aktien zusammen mehr als 60 % des Gesamtindex repräsentieren.

Die Laufzeitenanalyse für festverzinsliche Wertpapiere, die als Sicherheit entgegengenommen oder gestellt werden, basiert auf dem jeweiligen vertraglichen Fälligkeitsdatum. Als Sicherheiten entgegengenommene oder gestellte Aktien und börsengehandelte Fonds (ETFs) werden indes als offene Transaktionen ausgewiesen, da sie keinem vertraglich festgelegten Fälligkeitsdatum unterliegen.

Verwahrung erhaltener Sicherheiten

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Beträge der unbaren Sicherheiten, welche die Fonds in Verbindung mit Wertpapierleihtransaktionen entgegengenommen haben und die von der Verwahrstelle der Fonds (oder deren Beauftragten) oder über ein Wertpapierabrechnungssystem gehalten werden. Stand: 31. Mai 2023.

| Verwahrstelle | Erhaltene unbare Sicherheiten Wertpapierleihe |
|--|---|
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 2.492.348 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 33.186.621 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 10.012.096 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | |
| EUROCLEAR | 99.922.883 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 22.324.286 |
| Gesamt | 122.247.169 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | |
| EUROCLEAR | 1.499.092 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 976.910 |
| Gesamt | 2.476.002 |
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 18.783.870 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 48.297.388 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Verwahrstelle | Erhaltene unbare Sicherheiten |
|--|----------------------------------|
| | Wertpapierleihe |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | |
| EUROCLEAR | 18.771.541 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 9.291.889 |
| Gesamt | 28.063.430 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 730.650 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | |
| EUROCLEAR | 117.146 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 589.985 |
| Gesamt | 707.131 |
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | |
| EUROCLEAR | 14.026.991 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 131.968.014 |
| Gesamt | 145.995.005 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 62.709.269 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 65.933 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 7.822.952 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (in EUR) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 23.446.569 |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (in EUR) | |
| EUROCLEAR | 33.516.801 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 61.493.873 |
| Gesamt | 95.010.674 |
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | |
| EUROCLEAR | 11.604.007 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 6.523.521 |
| Gesamt | 18.127.528 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | |
| EUROCLEAR | 3.655.815 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 4.189.164 |
| Gesamt | 7.844.979 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | |
| EUROCLEAR | 10.105.167 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 10.922.254 |
| Gesamt | 21.027.421 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | |
| EUROCLEAR | 110.574.881 |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 64.400.221 |
| Gesamt | 174.975.102 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 22.598.112 |
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund (in USD) | |
| State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (oder ihre Bevollmächtigten) | 7.388.228 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

Konzentration der erhaltenen Sicherheiten

Die folgende Tabelle führt die zehn größten Emittenten nach Wert der unbaren Sicherheiten auf, die von den Fonds mittels einer Vollrechtsübertragungsvereinbarung über Wertpapierleihtransaktionen und OTC-FD angenommen wurden. Stand: 31. Mai 2023.

| Emittenten | Wert |
|---|------------|
| BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (in USD) | |
| Atlassian Corp | 722.799 |
| Otsuka Holdings Co Ltd | 403.124 |
| Burford Capital Ltd | 238.975 |
| NU Holdings Ltd | 109.647 |
| South32 Ltd | 86.429 |
| Rolls-Royce Holdings Plc | 85.927 |
| Renesas Electronics Corp | 70.837 |
| Suntory Beverage & Food Ltd | 56.029 |
| DBV Technologies SA | 55.696 |
| Publicis Groupe SA | 47.580 |
| BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (in EUR) | |
| Coupang LLC | 8.889.920 |
| Shopify Inc | 6.720.293 |
| BHP Group Ltd | 2.101.676 |
| United Kingdom | 1.427.748 |
| United States Treasury | 1.358.693 |
| French Republic | 1.341.095 |
| Origin Energy Ltd | 1.068.915 |
| Screaming Eagle Acquisition Corp | 629.218 |
| International Flavors & Fragrances Inc | 629.212 |
| Flutter Entertainment Plc | 543.490 |
| BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (in USD) | |
| BHP Group Ltd | 3.826.725 |
| Origin Energy Ltd | 1.946.279 |
| Lululemon Athletica Inc | 388.061 |
| Network International Holdings Plc | 386.336 |
| Flutter Entertainment Plc | 224.411 |
| Haleon Plc | 200.095 |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 199.264 |
| ANZ Group Holdings Ltd | 191.467 |
| Exelixis Inc | 153.161 |
| Coupang LLC | 152.334 |
| BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (in USD) | |
| United States Treasury | 40.122.647 |
| Republic of Germany | 25.832.342 |
| French Republic | 10.602.359 |
| United Kingdom | 10.031.183 |
| Republic of Austria | 9.656.633 |
| Kingdom of Netherlands | 8.053.086 |
| Kingdom of Belgium | 5.322.499 |
| Government of Canada | 3.513.074 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 2.579.308 |
| Selective Insurance Group Inc | 378.118 |
| BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (in USD) | |
| United States Treasury | 802.408 |
| Republic of Germany | 417.643 |
| French Republic | 220.226 |
| United Kingdom | 218.511 |
| Republic of Austria | 185.338 |
| Kingdom of Netherlands | 174.963 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 97.551 |
| Kingdom of Belgium | 41.039 |
| Renesas Electronics Corp | 31.927 |
| Cellnex Telecom SA | 31.635 |

| Emittenten | Wert |
|---|-----------|
| BlackRock European Absolute Return Fund (in EUR) | |
| French Republic | 3.089.846 |
| United Kingdom | 2.960.661 |
| Republic of Austria | 2.563.813 |
| Kingdom of Netherlands | 2.538.409 |
| Republic of Germany | 1.626.785 |
| Kingdom of Sweden | 1.588.375 |
| Kingdom of Belgium | 1.351.074 |
| BHP Group Ltd | 853.668 |
| United States Treasury | 524.365 |
| Origin Energy Ltd | 434.177 |
| BlackRock European Opportunities Extension Fund (in EUR) | |
| Coupang LLC | 9.492.503 |
| Shopify Inc | 7.175.812 |
| United Kingdom | 2.152.615 |
| French Republic | 2.141.367 |
| United States Treasury | 2.069.815 |
| BHP Group Ltd | 1.982.522 |
| Republic of Germany | 1.573.141 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 1.389.618 |
| Origin Energy Ltd | 1.008.314 |
| ABB Ltd Reg | 982.198 |
| BlackRock European Select Strategies Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 6.475.180 |
| Republic of Germany | 4.789.973 |
| French Republic | 3.242.762 |
| United Kingdom | 2.300.615 |
| Kingdom of Netherlands | 2.003.277 |
| Coupang LLC | 1.739.987 |
| Republic of Austria | 1.422.084 |
| Shopify Inc | 1.315.334 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 927.101 |
| Kingdom of Belgium | 490.531 |
| BlackRock European Unconstrained Equity Fund (in EUR) | |
| United Kingdom | 123.704 |
| United States Treasury | 123.703 |
| French Republic | 114.312 |
| International Flavors & Fragrances Inc | 65.107 |
| Screaming Eagle Acquisition Corp | 65.107 |
| Kesko Oyj | 49.387 |
| Lamb Weston Holdings Inc | 32.621 |
| Ahren Acquisition Corp | 30.753 |
| FTAC Zeus Acquisition Corp | 29.024 |
| Tesla Inc | 17.440 |
| BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (in EUR) | |
| Coupang LLC | 223.558 |
| Shopify Inc | 168.998 |
| United Kingdom | 58.233 |
| French Republic | 58.230 |
| Republic of Germany | 35.607 |
| United States Treasury | 35.466 |
| Inter-American Development Bank | 27.826 |
| International Bank for Reconstruction & Development | 24.575 |
| Kingdom of Netherlands | 22.628 |
| Kingdom of Belgium | 22.627 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Emittenten | Wert |
|--|------------|
| BlackRock Global Event Driven Fund (in USD) | |
| BHP Group Ltd | 20.042.916 |
| elf Beauty Inc | 15.719.245 |
| Novartis AG Reg | 14.802.327 |
| United States Treasury | 13.107.624 |
| Rio Tinto Plc | 11.470.015 |
| Origin Energy Ltd | 10.193.860 |
| SAP SE | 7.425.068 |
| United Kingdom | 6.687.407 |
| French Republic | 6.682.258 |
| Kingdom of Belgium | 4.963.063 |
| BlackRock Global Real Asset Securities Fund (in USD) | |
| BHP Group Ltd | 9.599.109 |
| elf Beauty Inc | 5.575.960 |
| Novartis AG Reg | 5.250.710 |
| Origin Energy Ltd | 4.882.123 |
| Rio Tinto Plc | 4.068.666 |
| United States Treasury | 3.296.815 |
| United Kingdom | 2.719.441 |
| SAP SE | 2.633.835 |
| French Republic | 2.579.399 |
| Microsoft Corp | 1.069.943 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (in EUR) | |
| French Republic | 11.931 |
| Republic of Germany | 11.931 |
| Kingdom of Belgium | 11.931 |
| Kingdom of Netherlands | 11.930 |
| Government of Canada | 11.927 |
| United States Treasury | 6.283 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (in EUR) | |
| Kingdom of Belgium | 1.415.580 |
| Republic of Germany | 1.415.577 |
| Kingdom of Netherlands | 1.415.575 |
| French Republic | 1.415.558 |
| Government of Canada | 1.415.190 |
| United States Treasury | 745.472 |
| BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (in EUR) | |
| Haleon Plc | 2.336.595 |
| Flutter Entertainment Plc | 2.336.351 |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 2.326.889 |
| CRH Plc | 1.755.676 |
| Centrica Plc | 1.258.574 |
| Mondi Plc | 1.249.018 |
| Unilever Plc | 1.223.862 |
| Baloise Holding AG | 1.153.704 |
| Keyence Corp | 1.037.427 |
| Sanmina Corp | 791.157 |
| BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 16.915.200 |
| Imperial Brands Plc | 11.534.721 |
| British American Tobacco Plc | 11.485.181 |
| CRH Plc | 10.645.401 |
| Republic of Germany | 10.196.261 |
| French Republic | 4.327.134 |
| United Kingdom | 4.092.274 |
| Kingdom of Netherlands | 3.894.514 |
| Republic of Austria | 2.921.764 |
| Kingdom of Norway | 1.561.946 |

| Emittenten | Wert |
|---|------------|
| BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 3.516.758 |
| French Republic | 2.992.212 |
| Republic of Germany | 2.846.245 |
| United Kingdom | 2.739.186 |
| Republic of Austria | 1.989.359 |
| Kingdom of Netherlands | 1.232.242 |
| Inter-American Development Bank | 612.022 |
| International Bank for Reconstruction & Development | 543.508 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 446.004 |
| Kingdom of Belgium | 407.985 |
| BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 2.828.568 |
| Republic of Germany | 1.233.806 |
| French Republic | 888.218 |
| United Kingdom | 882.865 |
| Republic of Austria | 882.487 |
| Kingdom of Netherlands | 798.228 |
| Kingdom of Belgium | 327.161 |
| European Investment Bank | 3.237 |
| Republic of Finland | 402 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 9 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 4.734.890 |
| Republic of Germany | 3.540.766 |
| French Republic | 2.190.596 |
| United Kingdom | 2.101.002 |
| Republic of Austria | 1.066.865 |
| Inter-American Development Bank | 867.054 |
| International Bank for Reconstruction & Development | 767.710 |
| Kingdom of Netherlands | 527.040 |
| Renesas Electronics Corp | 438.023 |
| Cellnex Telecom SA | 434.021 |
| BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (in EUR) | |
| United States Treasury | 40.224.242 |
| Republic of Germany | 29.295.443 |
| Kingdom of Netherlands | 12.355.897 |
| French Republic | 11.128.920 |
| United Kingdom | 9.556.871 |
| Republic of Austria | 9.109.952 |
| Kingdom of Norway | 6.251.402 |
| Kingdom of Denmark | 5.879.110 |
| Selective Insurance Group Inc | 3.938.373 |
| Kingdom of Belgium | 3.497.832 |
| BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (in USD) | |
| Atlassian Corp | 4.286.425 |
| Otsuka Holdings Co Ltd | 2.390.652 |
| Burford Capital Ltd | 1.417.196 |
| French Republic | 1.334.182 |
| BHP Group Ltd | 1.133.336 |
| United Kingdom | 1.069.467 |
| Republic of Germany | 1.003.917 |
| Kingdom of Netherlands | 780.474 |
| NU Holdings Ltd | 650.241 |
| United States Treasury | 645.966 |

Effiziente Portfolioverwaltung und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) Fortsetzung

| Emittenten | Wert |
|---|---------|
| BlackRock Systematic Sustainable Global Equity Fund (in USD) | |
| French Republic | 749.327 |
| United Kingdom | 740.032 |
| BHP Group Ltd | 642.177 |
| Republic of Germany | 537.370 |
| United States Treasury | 457.738 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 353.360 |
| Origin Energy Ltd | 326.612 |
| Republic of Austria | 297.192 |
| Kingdom of Netherlands | 277.242 |
| Kingdom of Sweden | 184.136 |

Keine als Sicherheiten von einem einzelnen Emittenten in Bezug auf effizientes Portfolio-Management und OTC-FDIs entgegengenommenen Wertpapiere überstiegen 20 % des NIW des entsprechenden Fonds zum Jahresende.

Keiner der Fonds wurde vollständig durch von einem EU-Mitgliedstaat zum Abschlussstichtag gestellte oder zugesicherte Wertpapiere besichert.

Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen (ungeprüft)

Glossar und wesentliche Begriffsbestimmungen

Die nachstehend aufgeführten periodischen Offenlegungen werden für das am 31. Mai 2023 endende Geschäftsjahr, den „Referenzzeitraum“, dargestellt.

Alle für die Anlagen des Fonds und andere offengelegte quantitative Messgrößen dargestellten Daten wurden auf der Grundlage eines Durchschnitts des Wertes der Anlagen berechnet, die gehandelt und gehalten wurden, und zwar zu jedem Quartalsende innerhalb des Referenzzeitraums, für den die betreffenden Fonds die Kriterien eines Fonds nach Artikel 8 erfüllen. Bei Kennzahlen, die mit Nachhaltigkeitsindikatoren dargestellt werden, bezieht sich die entsprechende Kennzahlberechnung auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, und nicht auf alle Anlagen, die der Fonds hält.

Alle diese vorgelegten Daten sind ungeprüft und unterliegen keiner Zusicherung durch den Abschlussprüfer des Fonds oder einer Überprüfung durch einen Dritten.

Der Begriff „Vermögenswerte“ bezeichnet den Gesamtwert der vom Fonds während des Referenzzeitraums gehaltenen Anlagen.

Die Anlagen umfassen Zahlungsmittel gemäß Artikel 53 der technischen Regulierungsstandards im Rahmen der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288. Die allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätze in Luxemburg erfordern jedoch, dass Zahlungsmittel separat behandelt werden. Daher wird es für die Zwecke des Gesamtjahresberichts einen Unterschied in der Darstellung geben.

Nachhaltige Investitionen: BlackRock definiert nachhaltige Investitionen als Investitionen in Emittenten oder Wertpapiere, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beitragen und keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigen, vorausgesetzt dass die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. BlackRock bezieht sich auf einschlägige Nachhaltigkeitsrahmen, um die Ausrichtung der Investition auf ökologische oder soziale Ziele zu ermitteln.

Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen (do no significant harm, „DNSH“): Die von BlackRock durchgeführte Bewertung, um festzustellen, ob eine Investition ein Umweltziel oder soziales Ziel im Rahmen der SFDR erheblich beeinträchtigt. BlackRock hat eine Reihe von Kriterien für alle nachhaltigen Investitionen entwickelt, um zu beurteilen, ob eine Investition ein Ziel erheblich beeinträchtigt, wobei sowohl Datenpunkte von Drittanbietern als auch Fundamentalanalysen berücksichtigt werden. Investitionen werden anhand dieser Kriterien mithilfe systembasierter Kontrollen überprüft. Investitionen, die als besonders schädlich eingestuft werden, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

Nachhaltigkeitsindikatoren: Angelegenheiten in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte, Korruptionsbekämpfung und Bestechungsbekämpfung.

Haftungsausschluss

Bestimmte nachstehend aufgeführte Informationen (die „Informationen“) wurden von Anbietern von Marktdaten an BlackRock (von denen einige registrierte Anlageberater gemäß dem Investment Advisers Act von 1940 sein können) (jeweils ein „Informationsanbieter“), bereitgestellt, und sie dürfen ohne vorherige schriftliche Genehmigung dieses Informationsanbieters weder ganz noch teilweise vervielfältigt oder verbreitet werden. Die Informationen wurden weder der US-SEC noch einer anderen Aufsichtsbehörde vorgelegt oder von dieser genehmigt. Die Informationen dürfen nicht zur Erstellung abgeleiteter Werke oder im Zusammenhang mit einem Angebot zum Kauf oder Verkauf oder einer Verkaufsförderung oder Empfehlung für ein Wertpapier, ein Finanzinstrument oder ein Produkt oder eine Handelsstrategie verwendet werden und stellen auch kein solches Angebot, keine solche Verkaufsförderung oder Empfehlung dar noch sollten sie als Hinweis oder Garantie für eine zukünftige Wertentwicklung, Analyse, Vorhersage oder Prognose dienen. Die Informationen werden „wie besehen“ zur Verfügung gestellt, und der Benutzer der Informationen übernimmt das gesamte Risiko einer etwaigen Nutzung (oder Ermöglichung der Nutzung) der Informationen. Der Informationsanbieter gibt keine Zusicherungen oder ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien ab (die ausdrücklich ausgeschlossen werden), noch übernimmt er eine Haftung für Fehler oder Auslassungen in den Informationen oder für damit verbundene Schäden. Das Vorstehende stellt keinen Haftungsausschluss und keine Haftungsbeschränkung dar, die nicht durch geltendes Recht ausgeschlossen oder beschränkt werden können. Informationsanbieter gelten im Hinblick auf die Bestimmungen dieses Absatzes als Drittbegünstigte, die berechtigt sind, diese Bestimmungen gegenüber Dritten durchzusetzen.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock European Unconstrained Equity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300X1JZDUCHO0GO16

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __%

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen.
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Der Fonds verwendet die proprietäre Methodik der „Fundamentalanalyse“ von BlackRock. Der Fonds kann in begrenztem Umfang in Emittenten mit Engagement in Kernwaffen, fossilen Brennstoffen, Tabak und zivilen Schusswaffen anlegen. Diese Anlagen werden unter der Voraussetzung getätigt, dass sich die Emittenten in einer Phase des „Übergangs“ befinden und sich darauf konzentrieren, im Laufe der Zeit Nachhaltigkeitskriterien zu erfüllen. Emittenten, die die nachstehend aufgeführten Prüfkriterien nicht erfüllen, werden jedoch von der Anlage ausgeschlossen

Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen

Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus der direkten Beteiligung an der Produktion nuklearer Sprengköpfe erzielen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 25 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 25 % ihres Umsatzes aus der Produktion von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakerzeugnisse herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Großhandelsvertrieb und der Lieferung von Tabakerzeugnissen erzielen

Ausschluss von Emittenten mit Sitz in den Vereinigten Staaten, die Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den Einzelhandel mit Zivilpersonen herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion oder dem Einzelhandelsvertrieb von Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den zivilen Gebrauch erzielen

Ausschluss von Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben (welche die Bereiche Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung umfassen)

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|--|------------------------|-----------------------------------|
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage von Ausschlusskriterien, wie in der obigen Tabelle „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ festgelegt | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | Nachhaltigkeitsindikator | | | |
|---|---|---|--|--|
| | Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 25 % ihres Umsatzes aus der Produktion von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 25 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten | Ausschluss von Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben (welche die Bereiche Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung umfassen) |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | | P | P | |
| Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | | | | P |
| Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen) | F | | | |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---------------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------------|
| Novo Nordisk Class B | Gesundheitsversorgung | 9,13 % | Dänemark |
| Asml Holding Nv | Informationstechnologie | 9,03 % | Niederlande |
| Lvmh | Nicht-Basiskonsumgüter | 7,80 % | Frankreich |
| London Stock Exchange Group Plc | Finanzwesen | 6,64 % | Vereinigtes Königreich |
| Hermes International | Nicht-Basiskonsumgüter | 5,25 % | Frankreich |
| Ferrari Nv | Nicht-Basiskonsumgüter | 4,83 % | Italien |
| Nestle Sa | Basiskonsumgüter | 4,69 % | Schweiz |
| Spirax-Sarco Engineering Plc | Industrie | 4,56 % | Vereinigtes Königreich |
| Loreal Sa | Basiskonsumgüter | 4,27 % | Frankreich |
| Mastercard Inc Class A | Informationstechnologie | 4,15 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Lonza Group Ag | Gesundheitsversorgung | 3,97 % | Schweiz |
| Hexagon Class B | Informationstechnologie | 3,85 % | Schweden |
| S&P Global Inc | Finanzwesen | 3,75 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Auto Trader Group Plc | Kommunikation | 3,42 % | Vereinigtes Königreich |
| Assa Abloy B | Industrie | 3,39 % | Schweden |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

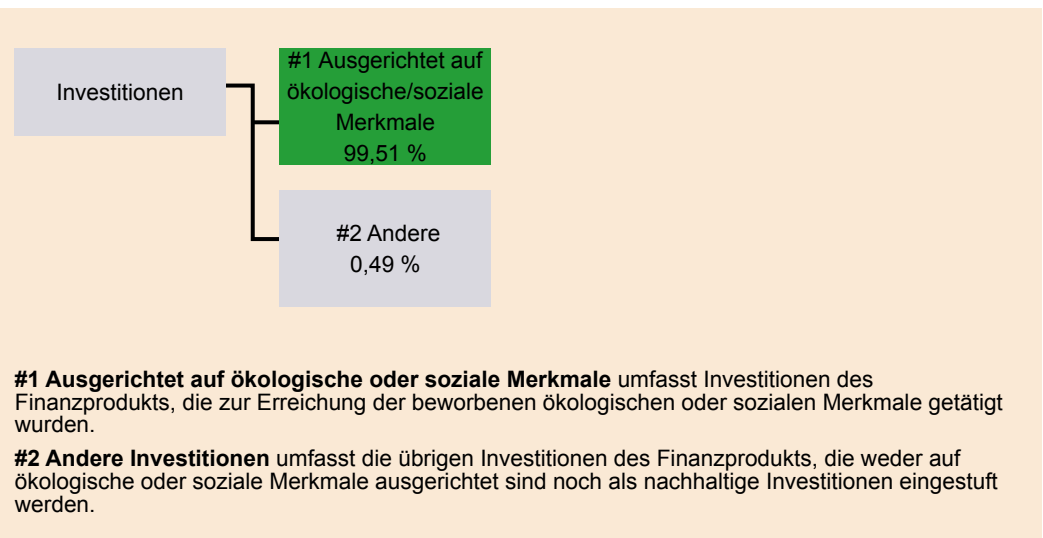
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------|---|---------------------|
| Nicht-Basiskonsumgüter | Fahrzeuge & Fahrzeugteile | 4,83 % |
| Basiskonsumgüter | Lebensmittel Getränke Tabak | 4,69 % |
| Basiskonsumgüter | Haushalts- & Persönliche Produkte | 4,27 % |
| Informationstechnologie | Technische Hardware und Ausrüstung | 3,85 % |
| Kommunikation | Medien und Unterhaltung | 3,42 % |
| Werkstoffe | Werkstoffe | 3,39 % |
| Industrie | Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen | 2,44 % |
| Energie | Integrierte Öl- und Gasindustrie | 0,41 % |
| Energie | Öl- und Gasanlagen und -dienstleistungen | 0,37 % |
| Energie | Veredelung und Vermarktung von Öl und Gas | 0,24 % |
| Energie | Öl- und Gasexploration und -produktion | 0,16 % |
| Energie | Öl- und Gasbohrung | 0,02 % |
| Energie | Kohle und verbrauchbare Brennstoffe | 0,01 % |

Während des Referenzzeitraums wurden keine der Anlagen des Fonds in den folgenden Teilsektoren (gemäß der Definition im Global Industry Classification System) gehalten: Öl- und Gaslagerung und -transport.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

Ja:

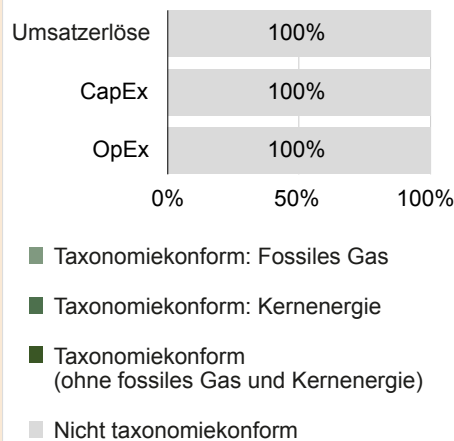
In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

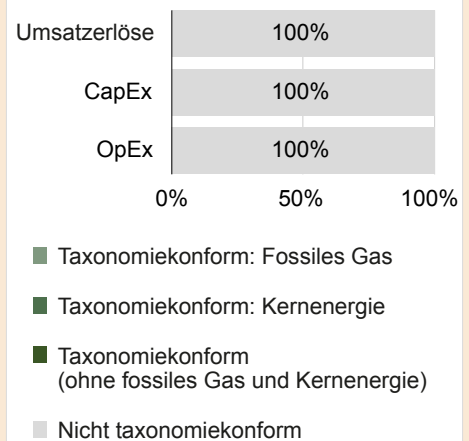
¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen umfassen Barmittel, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachten. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

Der Anlageberater unterliegt zudem den Anforderungen an die Einbeziehung von Anteilhabern gemäß der Aktionärsrechterichtlinie II (SRD). Ziel der SRD ist die Stärkung der Position der Anteilhaber, die Verbesserung der Transparenz und die Verringerung exzessiver Risiken innerhalb von Unternehmen, die auf regulierten EU-Märkten gehandelt werden. Weitere Einzelheiten zu den Tätigkeiten des Anlageberaters im Rahmen der SRD finden Sie auf der Webseite von BlackRock unter:

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300TP6J1LXOSC2P22

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%**
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein positives ESG-Ziel oder -Ergebnis verfolgen oder im Falle von Engagements in Staatsanleihen Benchmark-Indizes nachbilden, die ESG-Anforderungen enthalten oder aus Anleihen bestehen, die von Regierungen ausgegeben werden und über ein ESG-Rating von mindestens BB (wie von Drittanbietern von ESG-Daten definiert) verfügen, und in beiden Fällen Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Status, der mit der SFDR-Verordnung in Einklang ist

Verbesserung des bereinigten ESG-Score im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index

Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index um 30 %

Sicherstellung, dass mehr als 90% der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|-----------------------------------|
| Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein positives ESG-Ziel oder -Ergebnis verfolgen oder im Falle von Engagements in Staatsanleihen Benchmark-Indizes nachbilden, die ESG-Anforderungen enthalten oder aus Anleihen bestehen, die von Regierungen ausgegeben werden und über ein ESG-Rating von mindestens BB (wie von Drittanbietern von ESG-Daten definiert) verfügen, und in beiden Fällen Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Status, der mit der SFDR-Verordnung in Einklang ist | % der Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen | 92,65 % |
| Verbesserung des ESG-bereinigten Scores im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index | Prozentuale Verbesserung des ESG-Score im Vergleich zum Referenzindex | 1,18 % |
| Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit einem ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten |
| Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index um 30 % | Prozentuale Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität im Verhältnis zum Referenzindex | 40,28 % |

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | Nachhaltigkeitsindikator |
|--|--------------------------|
| | |
| Treibhausgasemissionen (THG) | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | P |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--------------------------------------|--------|-------------------------|--------|
| iShares MSCI Usa ESG Enhance | ETFs | 17,58 % | Irland |
| iShares Eur Govt Bond Climate UCITS | ETFs | 12,08 % | Irland |
| iShares \$ Corp Bond ESG UCITS | ETFs | 6,54 % | Irland |
| iShares MSCI Em ESG Enhanced | ETFs | 3,72 % | Irland |
| iShares J.P. Morgan ESG \$ EM | ETFs | 3,69 % | Irland |
| iShares \$ Treasury Bond 1-3Yr UCITS | ETFs | 3,17 % | Irland |
| Ishs China Cny Bond UCITS | ETFs | 2,99 % | Irland |
| iShares \$ TIPS UCITS ETF | ETFs | 2,93 % | Irland |
| iShares Physical Gold | ETC | 2,84 % | Irland |
| iShares Euro Inf-Lnk Govt Bd UCITS | ETFs | 2,50 % | Irland |
| iShares Euro Hy Corp Bnd ESG UCITS | ETFs | 2,24 % | Irland |
| iShares \$ High Yield Corp Bond | ETFs | 2,20 % | Irland |
| iShares MSCI Emu ESG Enhance | ETFs | 2,15 % | Irland |
| iShares MSCI Japan ESG Enhanced | ETFs | 1,93 % | Irland |
| iShares Core Uk Gilts UCITS ETF | ETFs | 1,59 % | Irland |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

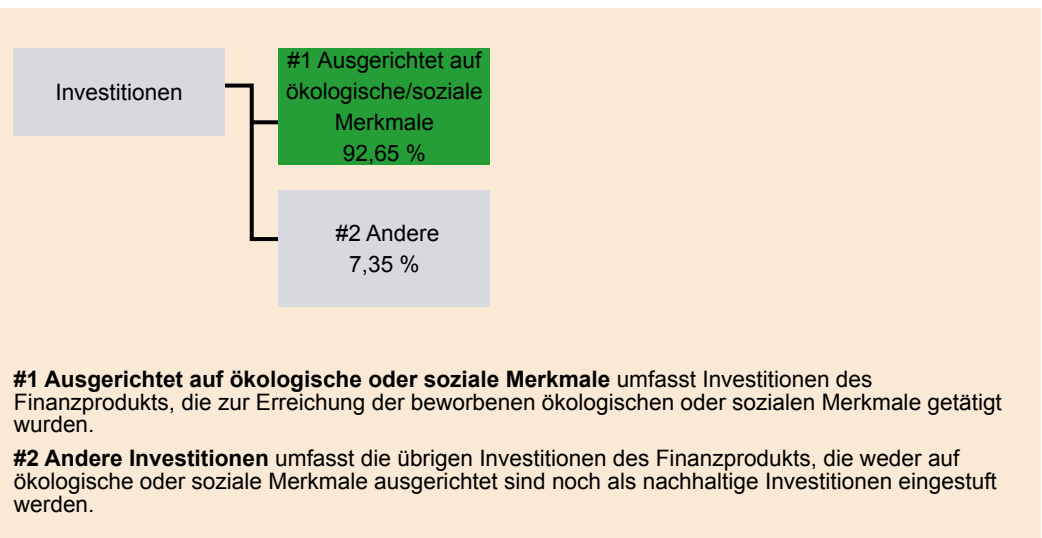
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------|--|---------------------|
| Staatliche Wertpapiere | Staatliche Wertpapiere | 46,82 % |
| Finanzwesen | Banken | 5,23 % |
| Finanzwesen | Finanzdienstleistungen | 4,64 % |
| Gesundheitsversorgung | Pharmaindustrie, Biotechnologie & Biowissenschaften | 3,59 % |
| Informationstechnologie | Software und Services | 3,48 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 2,86 % |
| Sonstige | Sonstige | 2,84 % |
| Informationstechnologie | Technische Hardware und Ausrüstung | 2,61 % |
| Kommunikation | Medien und Unterhaltung | 2,35 % |
| Informationstechnologie | Halbleiter und Halbleiterausrüstung | 2,31 % |
| Gesundheitsversorgung | Ausrüstung und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen | 2,29 % |
| Werkstoffe | Werkstoffe | 2,06 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Nicht-Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel | 1,86 % |
| Finanzwesen | Versicherung | 1,78 % |
| Basiskonsumgüter | Lebensmittel Getränke Tabak | 1,78 % |
| Versorger | Versorger | 1,77 % |
| Kommunikation | Telekommunikation | 1,46 % |
| Immobilien | Equity Real Estate Investment Trusts (REITs) | 1,34 % |
| Industrie | Transportwesen | 1,25 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Fahrzeuge & Fahrzeugteile | 1,16 % |
| Energie | Öl- und Gaslagerung und -transport | 0,50 % |

Im Referenzzeitraum wurden keine der Anlagen des Fonds in den folgenden Teilspektoren (gemäß der Definition im Global Industry Classification System) gehalten: integrierte Öl- und Gasindustrie, Erschließung und Produktion von Öl und Gas, Öl- und Gasbohrungen, Öl- und Gasanlagen und -dienstleistungen, Veredelung und Vermarktung von Öl und Gas oder Kohle und verbrauchbare Kraftstoffe.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

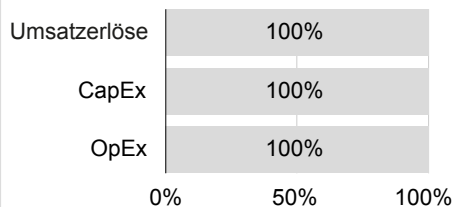
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

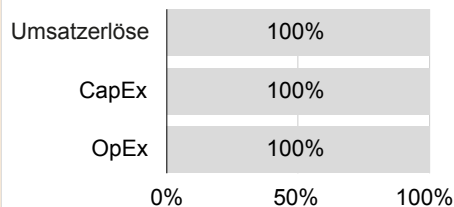
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Derivate, Barmittel und Anteile an OGA und festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldtitel bezeichnet) umfassen, die von Regierungen und staatlichen Stellen auf der ganzen Welt ausgegeben werden, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachen. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

Der Anlageberater unterliegt zudem den Anforderungen an die Einbeziehung von Anteilhabern gemäß der Aktionärsrichtlinie II (SRD). Ziel der SRD ist die Stärkung der Position der Anteilhaber, die Verbesserung der Transparenz und die Verringerung exzessiver Risiken innerhalb von Unternehmen, die auf regulierten EU-Märkten gehandelt werden. Weitere Einzelheiten zu den Tätigkeiten des Anlageberaters im Rahmen der SRD finden Sie auf der Webseite von BlackRock unter: <https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Conservative (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive

Unternehmenskennung (LEI-Code):
222100OG875X5JDSZ417

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%**
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein positives ESG-Ziel oder -Ergebnis verfolgen oder im Falle von Engagements in Staatsanleihen Benchmark-Indizes nachbilden, die ESG-Anforderungen enthalten oder aus Anleihen bestehen, die von Regierungen ausgegeben werden und über ein ESG-Rating von mindestens BB (wie von Drittanbietern von ESG-Daten definiert) verfügen, und in beiden Fällen Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Status, der mit der SFDR-Verordnung in Einklang ist

Verbesserung des bereinigten ESG-Score im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index

Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index um 30 %

Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|-----------------------------------|
| Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein positives ESG-Ziel oder -Ergebnis verfolgen oder im Falle von Engagements in Staatsanleihen Benchmark-Indizes nachbilden, die ESG-Anforderungen enthalten oder aus Anleihen bestehen, die von Regierungen ausgegeben werden und über ein ESG-Rating von mindestens BB (wie von Drittanbietern von ESG-Daten definiert) verfügen, und in beiden Fällen Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Status, der mit der SFDR-Verordnung in Einklang ist | % der Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen | 95,03 % |
| Verbesserung des ESG-bereinigten Scores im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index | Prozentuale Verbesserung des ESG-Score im Vergleich zum Referenzindex | 1,25 % |
| Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit einem ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten |
| Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index um 30 % | Prozentuale Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität im Verhältnis zum Referenzindex | 42,53 % |

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

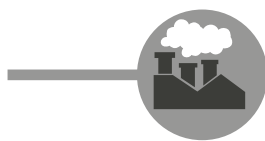
- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | Nachhaltigkeitsindikator |
|--|---|
| | Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index |
| Treibhausgasemissionen (THG) | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | P |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--------------------------------------|--------|-------------------------|-------------|
| iShares Eur Govt Bond Climate UCITS | ETFs | 18,18 % | Irland |
| iShares \$ Treasury Bond 7-10Yr Uci | ETFs | 14,45 % | Irland |
| iShares Eb.Rexx Gov Ger 0-1Yr UCITS | ETFs | 7,67 % | Deutschland |
| iShares \$ Treasury Bond 1-3Yr UCITS | ETFs | 6,90 % | Irland |
| iShares MSCI Usa ESG Enhance Usdha | ETFs | 6,32 % | Irland |
| iShares \$ Corp Bond ESG UCITS Usdha | ETFs | 6,01 % | Irland |
| iShares J.P. Morgan ESG \$ Em Usdha | ETFs | 4,92 % | Irland |
| iShares \$ TIPS UCITS ETF | ETFs | 4,86 % | Irland |
| iShares Euro Inf-Lnk Govt Bd UCITS | ETFs | 3,38 % | Irland |
| Ishe China Cny Bond UCITS Usd Hd D | ETFs | 3,36 % | Irland |
| iShares \$ High Yield Corp Bo Usdha | ETFs | 3,06 % | Irland |
| iShares Core Uk Gilts UCITS ETF | ETFs | 2,19 % | Irland |
| iShares \$ Treasury Bond 0-1Yr Usdhd | ETFs | 2,10 % | Irland |
| iShares Physical Gold | ETC | 1,95 % | Irland |
| iShares MSCI Em ESG Enhanced Usdha | ETFs | 1,21 % | Irland |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

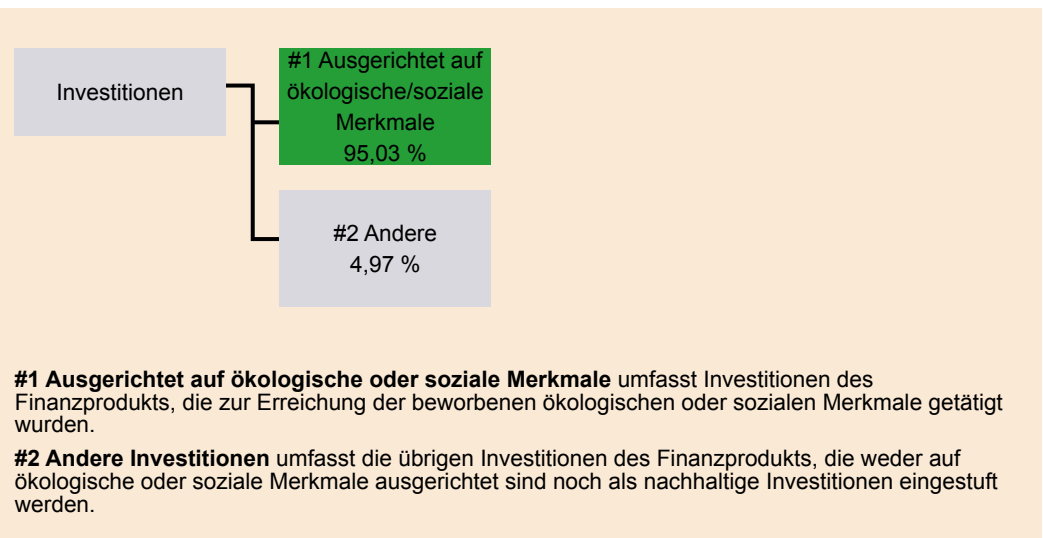
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------|--|---------------------|
| Staatliche Wertpapiere | Staatliche Wertpapiere | 69,07 % |
| Finanzwesen | Banken | 3,90 % |
| Finanzwesen | Finanzdienstleistungen | 3,43 % |
| Sonstige | Sonstige | 1,95 % |
| Gesundheitsversorgung | Pharmaindustrie, Biotechnologie & Biowissenschaften | 1,69 % |
| Informationstechnologie | Software und Services | 1,49 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 1,46 % |
| Kommunikation | Medien und Unterhaltung | 1,34 % |
| Gesundheitsversorgung | Ausrüstung und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen | 1,23 % |
| Werkstoffe | Werkstoffe | 1,10 % |
| Informationstechnologie | Technische Hardware und Ausrüstung | 1,07 % |
| Energie | Öl- und Gaslagerung und -transport | 0,35 % |
| Energie | Integrierte Öl- und Gasindustrie | 0,25 % |
| Energie | Öl- und Gasanlagen und -dienstleistungen | 0,16 % |
| Energie | Veredelung und Vermarktung von Öl und Gas | 0,15 % |
| Energie | Öl- und Gasexploration und -produktion | 0,09 % |
| Energie | Öl- und Gasbohrung | 0,03 % |
| Energie | Kohle und verbrauchbare Brennstoffe | 0,01 % |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

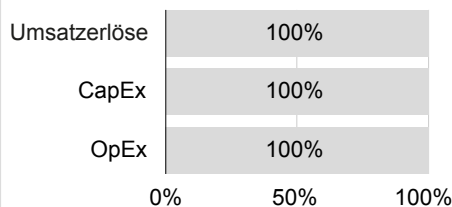
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

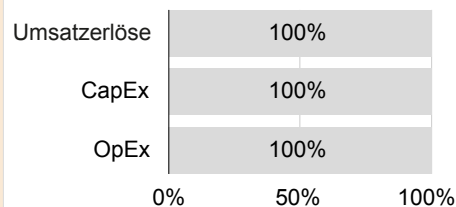
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Derivate, Barmittel und Anteile an OGA und festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldtitel bezeichnet) umfassen, die von Regierungen und staatlichen Stellen auf der ganzen Welt ausgegeben werden, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachen. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Defensive (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Managed Index Portfolios - Growth

Unternehmenskennung (LEI-Code):
222100YIE4XCGO4XH670

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%**
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein positives ESG-Ziel oder -Ergebnis verfolgen oder im Falle von Engagements in Staatsanleihen Benchmark-Indizes nachbilden, die ESG-Anforderungen enthalten oder aus Anleihen bestehen, die von Regierungen ausgegeben werden und über ein ESG-Rating von mindestens BB (wie von Drittanbietern von ESG-Daten definiert) verfügen, und in beiden Fällen Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Status, der mit der SFDR-Verordnung in Einklang ist

Verbesserung des bereinigten ESG-Score im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index

Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index um 30 %

Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|-----------------------------------|
| Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein positives ESG-Ziel oder -Ergebnis verfolgen oder im Falle von Engagements in Staatsanleihen Benchmark-Indizes nachbilden, die ESG-Anforderungen enthalten oder aus Anleihen bestehen, die von Regierungen ausgegeben werden und über ein ESG-Rating von mindestens BB (wie von Drittanbietern von ESG-Daten definiert) verfügen, und in beiden Fällen Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Status, der mit der SFDR-Verordnung in Einklang ist | % der Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen | 85,08 % |
| Verbesserung des ESG-bereinigten Scores im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index | Prozentuale Verbesserung des ESG-Score im Vergleich zum Referenzindex | 5,95 % |
| Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit einem ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten |
| Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index um 30 % | Prozentuale Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität im Verhältnis zum Referenzindex | 34,80 % |

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | Nachhaltigkeitsindikator |
|--|---|
| | Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index |
| Treibhausgasemissionen (THG) | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | P |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--------|-------------------------|--------|
| iShares MSCI Usa ESG Enhance Usdha | ETFs | 19,26 % | Irland |
| iShares MSCI Usa ESG Screened UCITS | ETFs | 8,75 % | Irland |
| iShares Edge MSCI Usa Minimum Usdha | ETFs | 8,54 % | Irland |
| iShares MSCI Em ESG Enhanced Usdha | ETFs | 8,53 % | Irland |
| iShares Edge MSCI Wrl Quality Fac | ETFs | 3,88 % | Irland |
| iShares MSCI Japan ESG Enhance Usdha | ETFs | 3,15 % | Irland |
| iShares MSCI Emu ESG Enhance Eurha | ETFs | 2,71 % | Irland |
| iShares \$ Corp Bond ESG UCITS Usd A | ETFs | 2,66 % | Irland |
| iShares MSCI World Momentum Usdha | ETFs | 2,35 % | Irland |
| iShares Eur Govt Bond Climate UCITS | ETFs | 2,32 % | Irland |
| iShares MSCI Canada UCITS ETF | ETFs | 2,25 % | Irland |
| iShares \$ Treasury Bond 7-10Yr Uci | ETFs | 2,11 % | Irland |
| iShares Edge MSCI Wrl Mv ESG Usd Acc | ETFs | 2,09 % | Irland |
| iShares Edge MSCI Europe Minimum Usdha | ETFs | 1,88 % | Irland |
| iShares Global Clean Energy UCITS | ETFs | 1,75 % | Irland |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

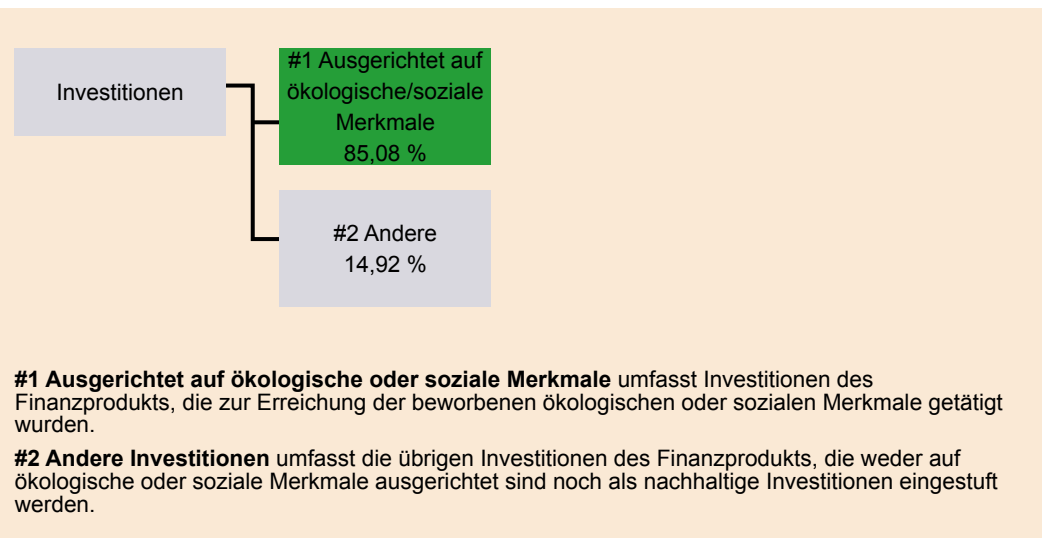
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------|--|---------------------|
| Staatliche Wertpapiere | Staatliche Wertpapiere | 13,19 % |
| Gesundheitsversorgung | Pharmaindustrie, Biotechnologie & Biowissenschaften | 7,67 % |
| Informationstechnologie | Software und Services | 7,03 % |
| Finanzwesen | Banken | 6,28 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 5,61 % |
| Finanzwesen | Finanzdienstleistungen | 5,44 % |
| Informationstechnologie | Technische Hardware und Ausrüstung | 5,09 % |
| Informationstechnologie | Halbleiter und Halbleiterrausrüstung | 4,42 % |
| Gesundheitsversorgung | Ausrüstung und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen | 4,03 % |
| Basiskonsumgüter | Lebensmittel Getränke Tabak | 3,74 % |
| Versorger | Versorger | 3,69 % |
| Kommunikation | Medien und Unterhaltung | 3,65 % |
| Werkstoffe | Werkstoffe | 3,63 % |
| Finanzwesen | Versicherung | 3,54 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Nicht-Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel | 3,33 % |
| Immobilien | Equity Real Estate Investment Trusts (REITs) | 2,04 % |
| Industrie | Transportwesen | 1,99 % |
| Kommunikation | Telekommunikation | 1,80 % |
| Industrie | Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen | 1,73 % |
| Sonstige | Sonstige | 1,64 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Fahrzeuge & Fahrzeugteile | 1,45 % |
| Basiskonsumgüter | Haushalts- & Persönliche Produkte | 1,43 % |
| Basiskonsumgüter | Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel | 1,40 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Verbraucherdienste | 1,34 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Langlebige Konsumgüter | 1,29 % |
| Energie | Öl- und Gaslagerung und -transport | 0,66 % |
| Energie | Integrierte Öl- und Gasindustrie | 0,62 % |
| Energie | Veredelung und Vermarktung von Öl und Gas | 0,50 % |
| Energie | Öl- und Gasexploration und -produktion | 0,47 % |
| Energie | Öl- und Gasanlagen und -dienstleistungen | 0,41 % |
| Energie | Kohle und verbrauchbare Brennstoffe | 0,02 % |
| Energie | Öl- und Gasbohrung | 0,01 % |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

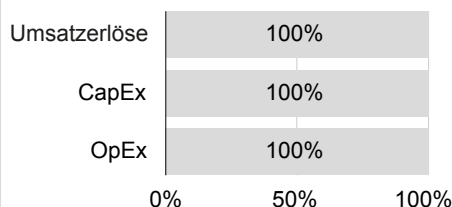
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

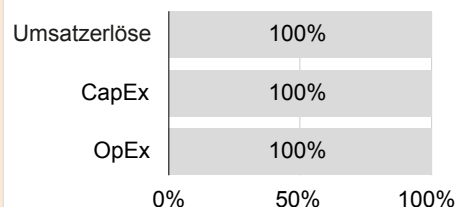
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Derivate, Barmittel und Anteile an OGA und festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldtitel bezeichnet) umfassen, die von Regierungen und staatlichen Stellen auf der ganzen Welt ausgegeben werden, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachen. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Growth (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate

Unternehmenskennung (LEI-Code):
2221005JLXKBTXXTSV51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%**
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein positives ESG-Ziel oder -Ergebnis verfolgen oder im Falle von Engagements in Staatsanleihen Benchmark-Indizes nachbilden, die ESG-Anforderungen enthalten oder aus Anleihen bestehen, die von Regierungen ausgegeben werden und über ein ESG-Rating von mindestens BB (wie von Drittanbietern von ESG-Daten definiert) verfügen, und in beiden Fällen Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Status, der mit der SFDR-Verordnung in Einklang ist

Verbesserung des bereinigten ESG-Score im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index

Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index um 30 %

Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|-----------------------------------|
| Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein positives ESG-Ziel oder -Ergebnis verfolgen oder im Falle von Engagements in Staatsanleihen Benchmark-Indizes nachbilden, die ESG-Anforderungen enthalten oder aus Anleihen bestehen, die von Regierungen ausgegeben werden und über ein ESG-Rating von mindestens BB (wie von Drittanbietern von ESG-Daten definiert) verfügen, und in beiden Fällen Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Status, der mit der SFDR-Verordnung in Einklang ist | % der Bestände an zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen | 90,32 % |
| Verbesserung des ESG-bereinigten Scores im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index | Prozentuale Verbesserung des ESG-Score im Vergleich zum Referenzindex | 2,58 % |
| Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit einem ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten |
| Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index um 30 % | Prozentuale Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität im Verhältnis zum Referenzindex | 35,35 % |

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

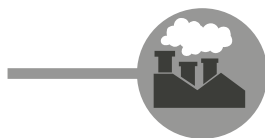
- Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | Nachhaltigkeitsindikator |
|--|---|
| | Reduzierung der Kohlenstoffemissionsintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse in den Beteiligungen des Fonds) im Vergleich zum MSCI All Country World Index und zum Bloomberg Multiverse Index |
| Treibhausgasemissionen (THG) | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | P |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--------------------------------------|--------|-------------------------|--------|
| iShares MSCI Usa ESG Enhance Usdha | ETFs | 14,98 % | Irland |
| iShares Eur Govt Bond Climate UCITS | ETFs | 8,86 % | Irland |
| iShares Edge MSCI Usa Minimum Usdha | ETFs | 6,54 % | Irland |
| iShares \$ Treasury Bond 1-3Yr UCITS | ETFs | 6,48 % | Irland |
| iShares \$ Corp Bond ESG UCITS Usdha | ETFs | 5,00 % | Irland |
| iShares MSCI Em ESG Enhanced Usdha | ETFs | 4,97 % | Irland |
| Ish Eur Gvt Bnd 0-1 ETF Eur Dist | ETFs | 4,50 % | Irland |
| iShares J.P. Morgan ESG \$ Em Usdha | ETFs | 4,17 % | Irland |
| iShares Physical Gold | ETC | 2,99 % | Irland |
| iShares Euro Inf-Lnk Govt Bd UCITS | ETFs | 2,64 % | Irland |
| iShares \$ High Yield Corp Bo Usdha | ETFs | 2,45 % | Irland |
| iShares \$ Treasury Bond 7-10Yr Uci | ETFs | 2,39 % | Irland |
| Ishs China Cny Bond UCITS Usd Hd D | ETFs | 2,10 % | Irland |
| iShares MSCI Japan ESG Enhance Usdha | ETFs | 2,00 % | Irland |
| iShares MSCI Emu ESG Enhance Eurha | ETFs | 1,95 % | Irland |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

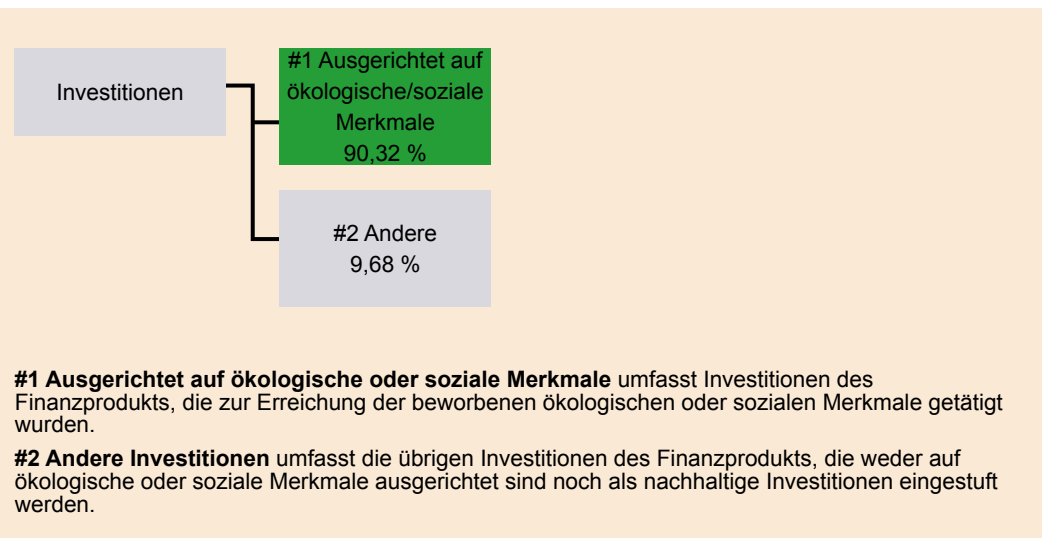
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------|--|---------------------|
| Staatliche Wertpapiere | Staatliche Wertpapiere | 38,37 % |
| Gesundheitsversorgung | Pharmaindustrie, Biotechnologie & Biowissenschaften | 4,99 % |
| Finanzwesen | Banken | 4,67 % |
| Finanzwesen | Finanzdienstleistungen | 4,49 % |
| Informationstechnologie | Software und Services | 4,31 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 3,73 % |
| Informationstechnologie | Technische Hardware und Ausrüstung | 3,11 % |
| Sonstige | Sonstige | 2,99 % |
| Informationstechnologie | Halbleiter und Halbleiterausrüstung | 2,65 % |
| Gesundheitsversorgung | Ausrüstung und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen | 2,65 % |
| Kommunikation | Medien und Unterhaltung | 2,62 % |
| Werkstoffe | Werkstoffe | 2,54 % |
| Versorger | Versorger | 2,49 % |
| Basiskonsumgüter | Lebensmittel Getränke Tabak | 2,46 % |
| Finanzwesen | Versicherung | 2,23 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Nicht-Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel | 2,15 % |
| Kommunikation | Telekommunikation | 1,67 % |
| Industrie | Transportwesen | 1,52 % |
| Immobilien | Equity Real Estate Investment Trusts (REITs) | 1,50 % |
| Industrie | Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen | 1,22 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Fahrzeuge & Fahrzeugteile | 1,12 % |
| Energie | Öl- und Gaslagerung und -transport | 0,60 % |
| Energie | Integrierte Öl- und Gasindustrie | 0,49 % |
| Energie | Öl- und Gasanlagen und -dienstleistungen | 0,34 % |
| Energie | Veredelung und Vermarktung von Öl und Gas | 0,33 % |
| Energie | Öl- und Gasexploration und -produktion | 0,30 % |
| Energie | Öl- und Gasbohrung | 0,03 % |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

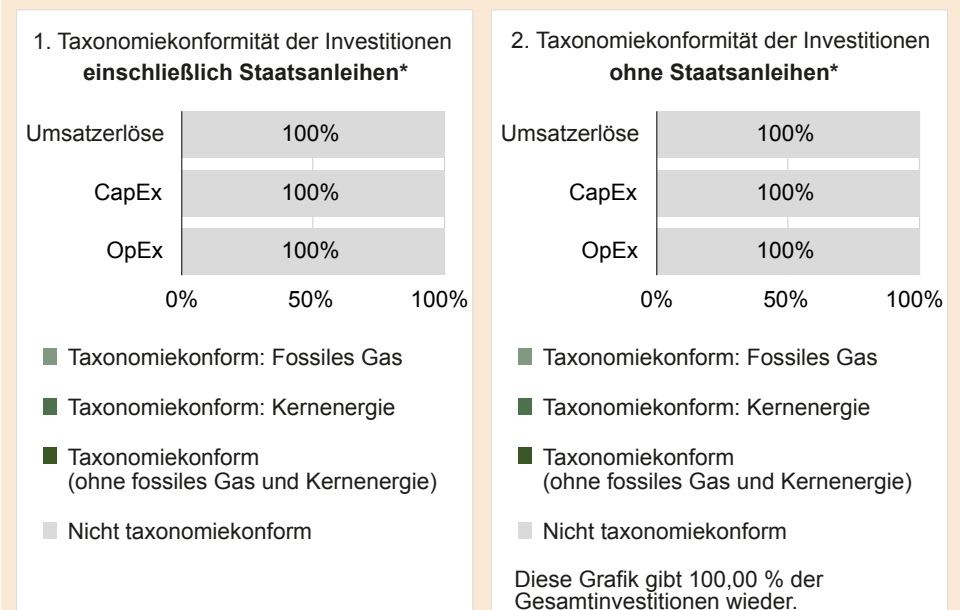
Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Barmittel und Derivate umfassen, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachten. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Managed Index Portfolios - Moderate (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
222100121T3B6974W335

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%**
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 23,11 % an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Anlage in nachhaltigen Investitionen

Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen

Verstärktes Engagement in Anlagen, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte im Vergleich zum Bloomberg Euro-Aggregate Index (80 %) und zum Bloomberg Global Aggregate Index (20 %) (der „ESG-Berichtsindex“) haben

Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben

Aufrechterhaltung des gewichteten durchschnittlichen ESG-Ratings der privaten Emittenten im Fonds gegenüber dem ESG-Rating der privaten Emittenten im ESG-Berichtsindex, nachdem mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus dem ESG-Berichtsindex eliminiert wurden

Reduzierung der Allokation des Fonds in Staatsanleihen im Vergleich zum FTSE World Government Bond Index und zum JP Morgan EMBI Global Diversified Index um mindestens 20 %. Der Fonds investiert nicht in die gemessen an ihrer ESG-Bewertung unteren 20 % der staatlichen Emittenten im weltweiten Universum der Staatsanleiheemittenten

Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen

Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus der direkten Beteiligung an der Produktion von Nuklearwaffen oder Nuklearwaffenkomponenten oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Hilfsdienstleistungen im Zusammenhang mit Nuklearwaffen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakerzeugnisse herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel und der Lieferung von Tabakerzeugnissen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den Einzelhandel mit Zivilpersonen herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Vertrieb (Groß- oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den zivilen Gebrauch erzielen

Ausschluss von Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben (welche die Bereiche Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung umfassen)

Ausschluss von Unternehmensemittenten mit einem MSCI ESG Controversy Score von eins oder darüber

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|--------------------------------------|
| Anlage in nachhaltigen Investitionen | % der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen | 23,11 % ¹ |
| Aufrechterhaltung des gewichteten durchschnittlichen ESG-Ratings der privaten Emittenten im Fonds gegenüber dem ESG-Rating der privaten Emittenten im ESG-Berichtsindex, nachdem mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus dem ESG-Berichtsindex eliminiert wurden | ESG-Rating relativ zum bereinigten ESG-Berichtsindex | Ziel für Ratingverbesserung erreicht |
| Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen | % der vom Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen | 17,26 % |
| Verstärktes Engagement in Anlagen, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie im Vergleich zum ESG-Berichtsindex positive externe Effekte haben | Vom Fonds gehaltene Anlagen, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte im Vergleich zum ESG-Berichtsindex haben | 70,88 % höher als der Referenzindex |
| Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit einem ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten |
| Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage von Ausschlusskriterien, wie in der obigen Tabelle „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

¹ Mit Wirkung zum 29. Dezember 2022 hat sich der Fonds verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten. Daher wird dieser Prozentsatz anhand von Daten vom 29. Dezember 2022 bis zum 31. Mai 2023 dargestellt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Im Referenzzeitraum legte der Fonds 23,11 % seiner Bestände in nachhaltigen Investitionen an, um sein Anlageziel zu erreichen.

Umwelt- und soziale Ziele

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die zu einer Reihe von ökologischen und/oder

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

sozialen Zielen beigetragen haben, zu denen unter anderem alternative und erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vermeidung oder Minderung von Umweltverschmutzung, Wiederverwendung und Recycling, Gesundheit, Ernährung, Sanitärversorgung und Bildung sowie die Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung und andere nachhaltigkeitsbezogene Rahmenwerke („Umwelt- und soziale Ziele“) gehören können.

Bewertung der wirtschaftlichen Aktivität

Eine Investition wurde als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet, wenn:

- (i) ein Mindestanteil der Geschäftsaktivität des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen hat; oder die Geschäftspraktiken des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen haben; oder
- (ii) die Verwendung der Erlöse („Use-of-Proceeds“) als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet wurde, beispielsweise grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen; oder
- (iii) die festverzinslichen Wertpapiere auf ein Umwelt- und/oder soziales Ziel ausgerichtet waren.

Bei den **wichtigsten nachteiligen**

Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die vom Fonds während des Referenzzeitraums gehaltenen nachhaltigen Investitionen erfüllen die Anforderungen des Grundsatzes der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („DNSH“) gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften. BlackRock hat eine Reihe von Kriterien für alle nachhaltigen Investitionen entwickelt, um zu beurteilen, ob ein Emittent oder eine Investition ein Ziel erheblich beeinträchtigt. Investitionen, von denen angenommen wird, dass sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

- Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren für jede Anlageart wurden mithilfe der proprietären Methodik von BlackRock für nachhaltige Investitionen bewertet. Alle relevanten obligatorischen PAI-Indikatoren in Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 22/1288 der Kommission wurden berücksichtigt. BlackRock nutzt Fundamentalanalysen und/oder Datenquellen Dritter, um Investitionen zu identifizieren, die sich nachteilig auf Nachhaltigkeitsfaktoren auswirken und erhebliche Beeinträchtigungen verursachen. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

Die im Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen wie grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen entsprechen den ICMA Green Bond Principles, ICMA Social Bond Principles oder gegebenenfalls den ICMA Sustainability Bond Guidelines. Die meisten PAI werden auf Emissionsebene für „Use-of-Proceeds“-Anleihen berücksichtigt, mit Ausnahme der Beteiligung an umstrittenen Waffen und der Verletzung des UN Global Compact oder der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, die auf Emittentenebene bewertet werden.

- Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nachhaltige Investitionen, die während des Referenzzeitraums gehalten wurden, wurden unter Berücksichtigung etwaiger nachteiliger Auswirkungen und unter Einhaltung der internationalen Standards der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und der UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte beurteilt, einschließlich der Grundsätze und Rechte, die in den acht Grundsatzkonventionen gemäß der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO) über die grundlegenden Prinzipien und Rechte bei der Arbeit und in der Internationalen Menschenrechtscharta festgelegt sind. Emittenten, die mutmaßlich gegen diese Konventionen verstoßen haben, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| | Nachhaltigkeitsindikator | | | | | |
|--|---|--|--|---|--|--------------------------------------|
| | Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben | Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung von kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten | Ausschluss von Emittenten, die an Verstößen gegen den UN Global Compact beteiligt waren, ermittelt durch MSCI oder einen anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageberater jeweils nutzt | Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen |
| Treibhausgasemissionen (THG) | | | | | | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | | | | | | P |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | | | P | P | | |
| Energieverbrauchsintensität pro Sektor mit hoher Klimabelastung | P | | | | | |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

| | |
|---|---|
| Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | P |
| Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen) | F |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|------------------------|-------------------------|-------------------------|
| BLK Leaf Fund Agency Acc TO Eur | Finanzinstitute | 3,74 % | Irland |
| Frankreich (Republik) Regs | Treasuries | 1,52 % | Frankreich |
| Europäische Union Regs | Staatliche Wertpapiere | 1,33 % | Supranationale Anleihen |
| Frankreich (Republik) Regs | Treasuries | 1,30 % | Frankreich |
| Italien (Republik) | Treasuries | 1,17 % | Italien |
| Deutschland (Bundesrepublik) | Treasuries | 1,02 % | Deutschland |
| Spanien (Königreich) | Treasuries | 1,02 % | Spanien |
| Italien (Republik) Regs | Treasuries | 0,99 % | Italien |
| Deutschland (Bundesrepublik) | Treasuries | 0,94 % | Deutschland |
| Spanien (Königreich) | Treasuries | 0,85 % | Spanien |
| Frankreich (Republik) Regs | Treasuries | 0,73 % | Frankreich |
| Spanien (Königreich) | Treasuries | 0,73 % | Spanien |
| Santander Uk Group Holdings Plc Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,72 % | Vereinigtes Königreich |
| Belgien (Königreich) | Treasuries | 0,70 % | Belgien |
| Deutschland (Bundesrepublik) Regs | Treasuries | 0,69 % | Deutschland |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

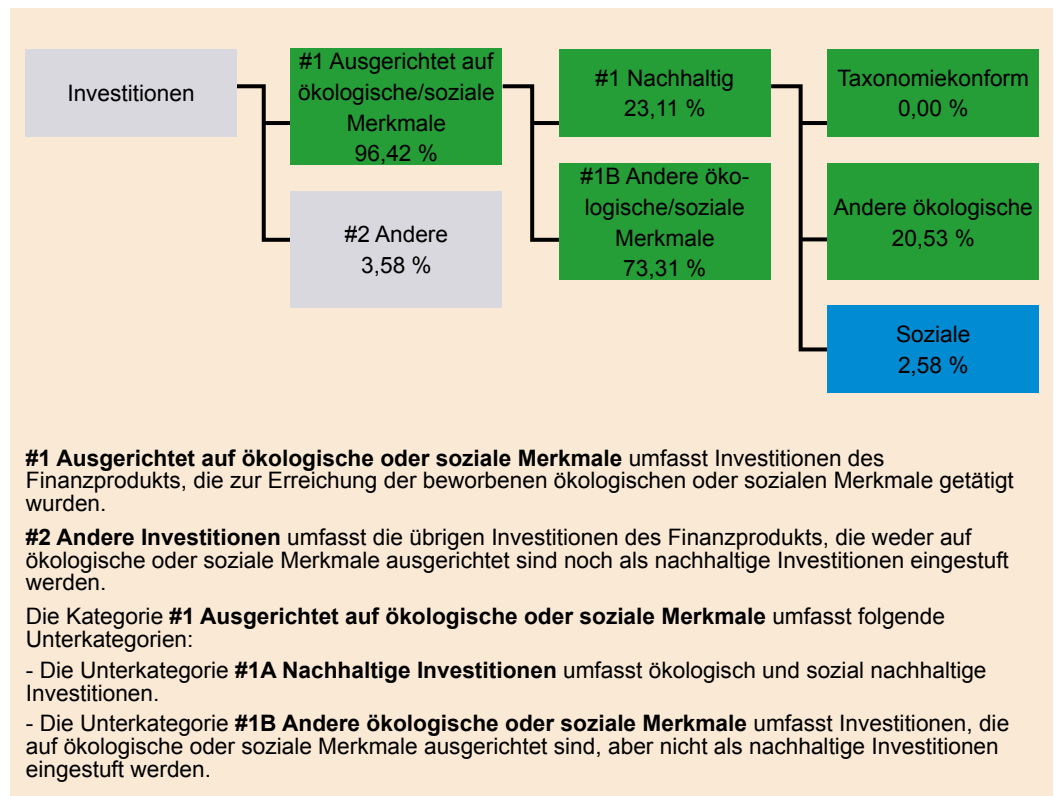
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|------------------------|-----------------------------|---------------------|
| Treasuries | Treasuries | 41,77 % |
| Finanzinstitute | Bankwesen | 13,92 % |
| Gedekte Anleihen | Mortgage Collateralized | 11,82 % |
| Staatliche Wertpapiere | Staatliche Wertpapiere | 9,64 % |
| Finanzinstitute | Finanzunternehmen | 3,80 % |
| Agency | Owned No Guarantee | 3,13 % |
| ABS | Sonstige | 2,74 % |
| Lokale Behörde | Lokale Behörde | 2,67 % |
| Versorger | Strom | 1,89 % |
| Industrie | Kommunikation | 1,47 % |
| Agency | Staatlich garantiert | 1,46 % |
| Industrie | Nicht zyklische Konsumgüter | 1,02 % |
| Industrie | Integriert | 0,20 % |
| Industrie | Metalle und Bergbau | 0,04 % |

Während des Referenzzeitraums wurden keine der Anlagen des Fonds in den folgenden Teilsektoren (gemäß der Definition im Barclays Industry Classification System) gehalten: unabhängige, Midstream, Ölfeld-Dienstleistungen, oder Veredelung.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

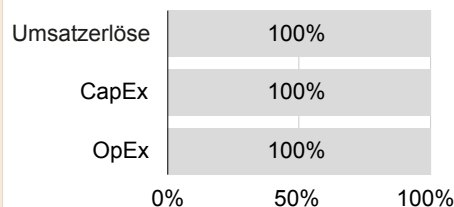
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

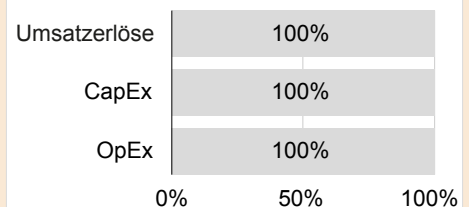
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 20,53 % der Investitionen des Fonds als nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel klassifiziert.

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die aus den folgenden Gründen nicht mit der EU-Taxonomie konform waren: (i) sie sind Teil der Anlagestrategie des Fonds; (ii) Daten zur Bestimmung der Konformität mit der EU-Taxonomie waren nicht verfügbar; und/oder (iii) die zugrunde liegenden Wirtschaftsaktivitäten waren nicht im Rahmen der verfügbaren technischen Screening-Kriterien der EU-Taxonomie zulässig oder erfüllten nicht alle Anforderungen dieser technischen Screening-Kriterien.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 2,58 % der Investitionen des Fonds als sozial nachhaltige Investitionen klassifiziert.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Barmittel, Derivate oder festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldtitel bezeichnet) umfassen, die von Regierungen und staatlichen Stellen auf der ganzen Welt ausgegeben werden, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachten. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300CRQVEIOJOFX498

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,76 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Anlage in nachhaltigen Investitionen

Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen

Verstärktes Engagement in Anlagen, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte im Vergleich zum Bloomberg Euro Corporate Index (80 %) und zum Bloomberg Global Corporate Index (20 %) (der „ESG-Berichtsindex“) haben

Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben

Aufrechterhaltung des gewichteten durchschnittlichen ESG-Ratings der privaten Emittenten im Fonds gegenüber dem ESG-Rating der privaten Emittenten im ESG-Berichtsindex, nachdem mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus dem ESG-Berichtsindex eliminiert wurden

Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen

Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus der direkten Beteiligung an der Produktion von Nuklearwaffen oder Nuklearwaffenkomponenten oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Hilfsdienstleistungen im Zusammenhang mit Nuklearwaffen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakerzeugnisse herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel und der Lieferung von Tabakerzeugnissen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den Einzelhandel mit Zivilpersonen herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Vertrieb (Groß- oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den zivilen Gebrauch erzielen

Ausschluss von Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben (welche die Bereiche Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung umfassen)

Ausschluss von Unternehmensemittenten mit einem MSCI ESG Controversy Score von eins oder darüber

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|--------------------------------------|
| Verstärktes Engagement in Anlagen, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie im Vergleich zum ESG-Berichtsindex positive externe Effekte haben | Vom Fonds gehaltene Anlagen, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte im Vergleich zum ESG-Berichtsindex haben | 18,53 % höher als der Referenzindex |
| Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Aufrechterhaltung des gewichteten durchschnittlichen ESG-Ratings der privaten Emittenten im Fonds gegenüber dem ESG-Rating der privaten Emittenten im ESG-Berichtsindex, nachdem mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus dem ESG-Berichtsindex eliminiert wurden | ESG-Rating relativ zum bereinigten ESG-Berichtsindex | Ziel für Ratingverbesserung erreicht |
| Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit einem ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage von Ausschlusskriterien, wie in der obigen Tabelle „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Anlage in nachhaltigen Investitionen | % der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen | 35,76 % ¹ |
| Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen | % der vom Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen | 15,96 % |

¹ Mit Wirkung zum 29. Dezember 2022 hat sich der Fonds verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten. Daher wird dieser Prozentsatz anhand von Daten vom 29. Dezember 2022 bis zum 31. Mai 2023 dargestellt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Im Referenzzeitraum legte der Fonds 35,76 % seiner Bestände in nachhaltigen Investitionen an, um sein Anlageziel zu erreichen.

Umwelt- und soziale Ziele

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die zu einer Reihe von ökologischen und/oder sozialen Zielen beigetragen haben, zu denen unter anderem alternative und erneuerbare Energien,

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Energieeffizienz, Vermeidung oder Minderung von Umweltverschmutzung, Wiederverwendung und Recycling, Gesundheit, Ernährung, Sanitärversorgung und Bildung sowie die Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung und andere nachhaltigkeitsbezogene Rahmenwerke („Umwelt- und soziale Ziele“) gehören können.

Bewertung der wirtschaftlichen Aktivität

Eine Investition wurde als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet, wenn:

- (i) ein Mindestanteil der Geschäftsaktivität des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen hat; oder die Geschäftspraktiken des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen haben; oder
- (ii) die Verwendung der Erlöse („Use-of-Proceeds“) als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet wurde, beispielsweise grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen; oder
- (iii) die festverzinslichen Wertpapiere auf ein Umwelt- und/oder soziales Ziel ausgerichtet waren.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die vom Fonds während des Referenzzeitraums gehaltenen nachhaltigen Investitionen erfüllten die Anforderungen des Grundsatzes der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („DNSH“) gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften. BlackRock hat eine Reihe von Kriterien für alle nachhaltigen Investitionen entwickelt, um zu beurteilen, ob ein Emittent oder eine Investition ein Ziel erheblich beeinträchtigt. Investitionen, von denen angenommen wird, dass sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren für jede Anlageart wurden mithilfe der proprietären Methodik von BlackRock für nachhaltige Investitionen bewertet. Alle relevanten obligatorischen PAI-Indikatoren in Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 22/1288 der Kommission wurden berücksichtigt. BlackRock nutzt Fundamentalanalysen und/oder Datenquellen Dritter, um Investitionen zu identifizieren, die sich nachteilig auf Nachhaltigkeitsfaktoren auswirken und erhebliche Beeinträchtigungen verursachen. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

Die im Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen wie grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen entsprechen den ICMA Green Bond Principles, ICMA Social Bond Principles oder gegebenenfalls den ICMA Sustainability Bond Guidelines. Die meisten PAI werden auf Emissionsebene für „Use-of-Proceeds“-Anleihen berücksichtigt, mit Ausnahme der Beteiligung an umstrittenen Waffen und der Verletzung des UN Global Compact oder der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, die auf Emittentenebene bewertet werden.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Nachhaltige Investitionen, die während des Referenzzeitraums gehalten wurden, wurden unter Berücksichtigung etwaiger nachteiliger Auswirkungen und unter Einhaltung der internationalen Standards der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und der UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte beurteilt, einschließlich der Grundsätze und Rechte, die in den acht Grundsatzkonventionen gemäß der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO) über die grundlegenden Prinzipien und Rechte bei der Arbeit und in der Internationalen Menschenrechtscharta festgelegt sind. Emittenten, die mutmaßlich gegen diese Konventionen verstoßen haben, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| | Nachhaltigkeitsindikator | | | | | |
|--|---|--|--|---|--|--------------------------------------|
| | Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben | Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung von kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten | Ausschluss von Emittenten, die an Verstößen gegen den UN Global Compact beteiligt waren, ermittelt durch MSCI oder einen anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageberater jeweils nutzt | Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen |
| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | | | | | | |
| Treibhausgasemissionen (THG) | | | | | | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | | | | | | P |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | | | P | P | | |
| Energieverbrauchsintensität pro Sektor mit hoher Klimabelastung | P | | | | | |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

| | |
|---|---|
| Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | P |
| Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen) | F |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|-----------------|-------------------------|--------------------------------|
| Jpmorgan Chase & Co Mtn Regs | Finanzinstitute | 1,20 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Deutsche Bank Ag Regs | Finanzinstitute | 0,96 % | Deutschland |
| Goldman Sachs Group Inc/The Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,90 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Goldman Sachs Group Inc/The Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,84 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Deriv Eur Balance With R67675 Luk | Finanzinstitute | 0,83 % | Europäische Union |
| Credit Suisse Group Ag Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,78 % | Schweiz |
| Morgan Stanley | Finanzinstitute | 0,78 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Barclays Plc Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,76 % | Vereinigtes Königreich |
| Bnp Paribas Sa Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,72 % | Frankreich |
| Chorus Ltd Mtn Regs | Industrie | 0,69 % | Neuseeland |
| Bank Of America Corp Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,65 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Credit Agricole Sa (London Branch) Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,64 % | Vereinigtes Königreich |
| Credit Suisse Group Ag Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,64 % | Schweiz |
| Dbs Group Holdings Ltd Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,61 % | Singapur |
| Santander Uk Group Holdings Plc Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,60 % | Vereinigtes Königreich |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

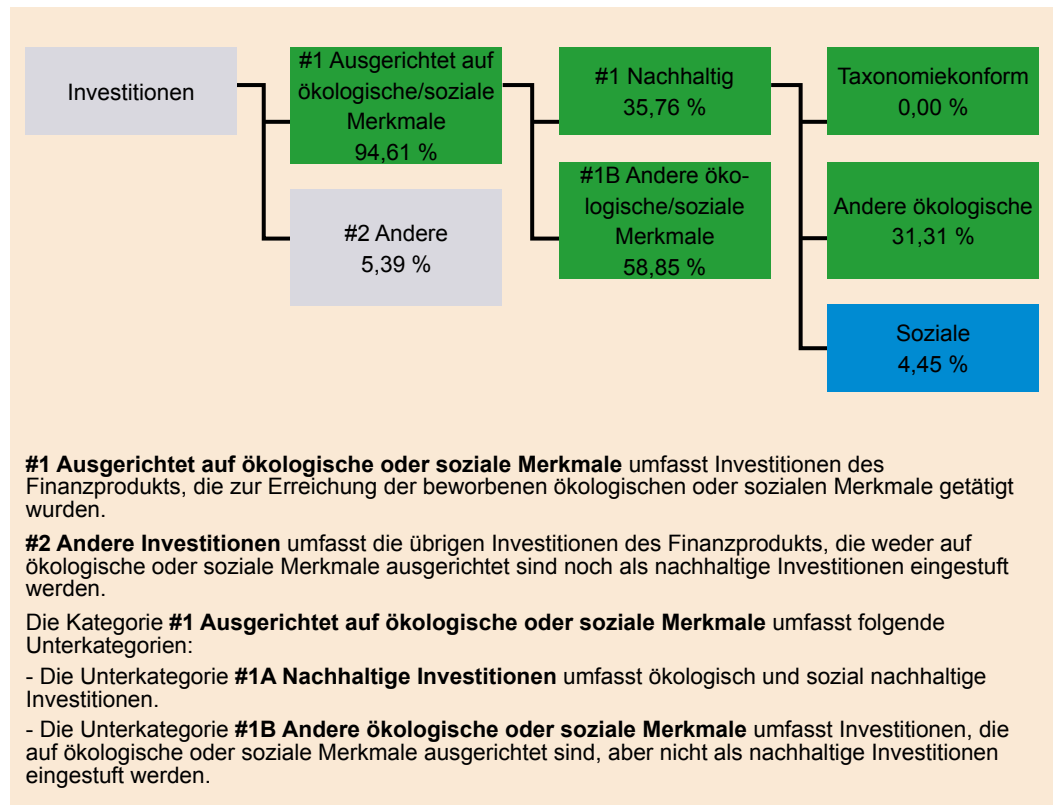
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------|----------------------------------|---------------------|
| Finanzinstitute | Bankwesen | 48,87 % |
| Industrie | Kommunikation | 6,87 % |
| Versorger | Strom | 5,58 % |
| Finanzinstitute | Finanzunternehmen | 5,10 % |
| Industrie | Nicht zyklische Konsumgüter | 4,80 % |
| Industrie | Zyklische Konsumgüter | 3,64 % |
| Industrie | Technologie | 3,38 % |
| Agency | Owned No Guarantee | 3,34 % |
| Gedeckte Anleihen | Mortgage Collateralized | 3,06 % |
| Finanzinstitute | Versicherung | 2,31 % |
| Versorger | Erdgas | 1,98 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 1,79 % |
| Finanzinstitute | Makler/Vermögensverwalter/Börsen | 1,47 % |
| Industrie | Transportwesen | 1,45 % |
| Industrie | Chemikalien | 1,36 % |
| Lokale Behörde | Lokale Behörde | 1,25 % |
| Treasuries | Treasuries | 1,22 % |
| Finanzinstitute | REITs | 1,08 % |
| Versorger | Sonstige Versorger | 1,04 % |
| Industrie | Integriert | 0,44 % |
| Industrie | Metalle und Bergbau | 0,06 % |
| Industrie | Unabhängig | 0,03 % |

Während des Referenzzeitraums wurden keine der Anlagen des Fonds in den folgenden Teilsektoren (gemäß der Definition im Barclays Industry Classification System) gehalten: Midstream, Ölfeld-Dienstleistungen oder Veredelung.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

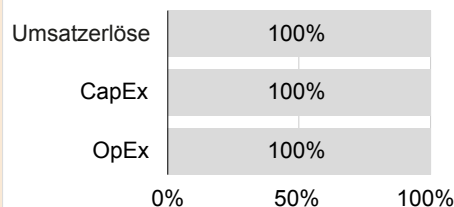
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

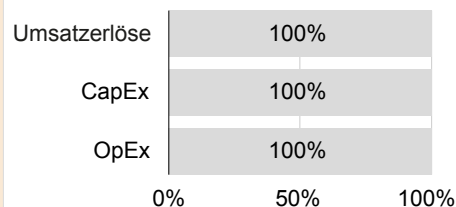
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 31,31 % der Investitionen des Fonds als nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel klassifiziert.

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die aus den folgenden Gründen nicht mit der EU-Taxonomie konform waren: (i) sie sind Teil der Anlagestrategie des Fonds; (ii) Daten zur Bestimmung der Konformität mit der EU-Taxonomie waren nicht verfügbar; und/oder (iii) die zugrunde liegenden Wirtschaftsaktivitäten waren nicht im Rahmen der verfügbaren technischen Screening-Kriterien der EU-Taxonomie zulässig oder erfüllten nicht alle Anforderungen dieser technischen Screening-Kriterien.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 4,45 % der Investitionen des Fonds als sozial nachhaltige Investitionen klassifiziert.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Barmittel und Derivate umfassen, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachten. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300UYLRDUZDE2XW97

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%**
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 25,70 % an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Anlage in nachhaltigen Investitionen

Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen

Verstärktes Engagement in Anlagen, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte im Vergleich zum ESG Bloomberg Euro-Aggregate Index (1-3 Years) (80 %) und zum Bloomberg Global Aggregate Index (1-3 Years) (20 %) (der „ESG-Berichtsindex“) haben

Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben

Aufrechterhaltung des gewichteten durchschnittlichen ESG-Ratings der privaten Emittenten im Fonds gegenüber dem ESG-Rating der privaten Emittenten im ESG-Berichtsindex, nachdem mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus dem ESG-Berichtsindex eliminiert wurden

Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden

Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen

Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus der direkten Beteiligung an der Produktion von Nuklearwaffen oder Nuklearwaffenkomponenten oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Hilfsdienstleistungen im Zusammenhang mit Nuklearwaffen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakerzeugnisse herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel und der Lieferung von Tabakerzeugnissen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den Einzelhandel mit Zivilpersonen herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Vertrieb (Groß- oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den zivilen Gebrauch erzielen

Ausschluss von Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben (welche die Bereiche Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung umfassen)

Ausschluss von Unternehmensemittenten mit einem MSCI ESG Controversy Score von eins oder darüber

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|--------------------------------------|
| Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Verstärktes Engagement in Anlagen, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie im Vergleich zum ESG-Berichtsindex positive externe Effekte haben | Vom Fonds gehaltene Anlagen, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte im Vergleich zum ESG-Berichtsindex haben | 77,44 % höher als der Referenzindex |
| Aufrechterhaltung des gewichteten durchschnittlichen ESG-Ratings der privaten Emittenten im Fonds gegenüber dem ESG-Rating der privaten Emittenten im ESG-Berichtsindex, nachdem mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus dem ESG-Berichtsindex eliminiert wurden | ESG-Rating relativ zum bereinigten ESG-Berichtsindex | Ziel für Ratingverbesserung erreicht |
| Anlage in nachhaltigen Investitionen | % der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen | 25,70 % ¹ |
| Sicherstellung, dass mehr als 90 % der Emittenten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert (ausgenommen Geldmarktfonds), über ein ESG-Rating verfügen oder für ESG-Zwecke analysiert wurden | % der Emittenten mit einem ESG-Rating | Über 90 % der Emittenten |
| Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen | % der vom Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen | 16,93 % |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage von Ausschlusskriterien, wie in der obigen Tabelle „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

¹ Mit Wirkung zum 29. Dezember 2022 hat sich der Fonds verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten. Daher wird dieser Prozentsatz anhand von Daten vom 29. Dezember 2022 bis zum 31. Mai 2023 dargestellt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Im Referenzzeitraum legte der Fonds 25,70 % seiner Bestände in nachhaltigen Investitionen an, um sein Anlageziel zu erreichen.

Umwelt- und soziale Ziele

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die zu einer Reihe von ökologischen und/oder sozialen Zielen beigetragen haben, zu denen unter anderem alternative und erneuerbare Energien,

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Energieeffizienz, Vermeidung oder Minderung von Umweltverschmutzung, Wiederverwendung und Recycling, Gesundheit, Ernährung, Sanitärversorgung und Bildung sowie die Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung und andere nachhaltigkeitsbezogene Rahmenwerke („Umwelt- und soziale Ziele“) gehören können.

Bewertung der wirtschaftlichen Aktivität

Eine Investition wurde als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet, wenn:

- (i) ein Mindestanteil der Geschäftsaktivität des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen hat; oder die Geschäftspraktiken des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen haben; oder
- (ii) die Verwendung der Erlöse („Use-of-Proceeds“) als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet wurde, beispielsweise grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen; oder
- (iii) die festverzinslichen Wertpapiere auf ein Umwelt- und/oder soziales Ziel ausgerichtet waren.

Bei den wichtigsten nachteiligen

Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die vom Fonds während des Referenzzeitraums gehaltenen nachhaltigen Investitionen erfüllten die Anforderungen des Grundsatzes der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („DNSH“) gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften. BlackRock hat eine Reihe von Kriterien für alle nachhaltigen Investitionen entwickelt, um zu beurteilen, ob ein Emittent oder eine Investition ein Ziel erheblich beeinträchtigt. Investitionen, von denen angenommen wird, dass sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

- Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren für jede Anlageart wurden mithilfe der proprietären Methodik von BlackRock für nachhaltige Investitionen bewertet. Alle relevanten obligatorischen PAI-Indikatoren in Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 22/1288 der Kommission wurden berücksichtigt. BlackRock nutzt Fundamentalanalysen und/oder Datenquellen Dritter, um Investitionen zu identifizieren, die sich nachteilig auf Nachhaltigkeitsfaktoren auswirken und erhebliche Beeinträchtigungen verursachen. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

Die im Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen wie grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen entsprechen den ICMA Green Bond Principles, ICMA Social Bond Principles oder gegebenenfalls den ICMA Sustainability Bond Guidelines. Die meisten PAI werden auf Emissionsebene für „Use-of-Proceeds“-Anleihen berücksichtigt, mit Ausnahme der Beteiligung an umstrittenen Waffen und der Verletzung des UN Global Compact oder der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, die auf Emittentenebene bewertet werden.

- Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nachhaltige Investitionen, die während des Referenzzeitraums gehalten wurden, wurden unter Berücksichtigung etwaiger nachteiliger Auswirkungen und unter Einhaltung der internationalen Standards der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und der UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte beurteilt, einschließlich der Grundsätze und Rechte, die in den acht Grundsatzkonventionen gemäß der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO) über die grundlegenden Prinzipien und Rechte bei der Arbeit und in der Internationalen Menschenrechtscharta festgelegt sind. Emittenten, die mutmaßlich gegen diese Konventionen verstoßen haben, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| | Nachhaltigkeitsindikator | | | | | |
|--|---|---|--|---|--|--------------------------------------|
| | Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben | Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung von Waffen (unter anderem einschließlich biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten | Ausschluss von Emittenten, die an Verstößen gegen den UN Global Compact beteiligt waren, ermittelt durch MSCI oder einen anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageberater jeweils nutzt | Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen |
| Treibhausgasemissionen (THG) | | | | | | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | | | | | | P |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | | | P | P | | |
| Energieverbrauchsintensität pro Sektor mit hoher Klimabelastung | P | | | | | |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

| | |
|---|---|
| Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | P |
| Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen) | F |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|------------|-------------------------|-------------|
| Spanien (Königreich) | Treasuries | 2,28 % | Spanien |
| Niederlande (Königreich) | Treasuries | 2,19 % | Niederlande |
| Italien (Republik) Regs | Treasuries | 1,96 % | Italien |
| Deutschland (Bundesrepublik) Regs | Treasuries | 1,86 % | Deutschland |
| Frankreich (Republik) Regs | Treasuries | 1,79 % | Frankreich |
| Italien (Republik) | Treasuries | 1,70 % | Italien |
| Kfw Mtn Regs | Treasuries | 1,64 % | Deutschland |
| Frankreich (Republik) Regs | Treasuries | 1,47 % | Frankreich |
| Instituto De Credito Oficial Mtn Regs | Agency | 1,35 % | Spanien |
| Frankreich (Republik) Regs | Treasuries | 1,25 % | Frankreich |
| Österreich (Republik) | Treasuries | 1,15 % | Österreich |
| Frankreich (Republik) Regs | Treasuries | 1,07 % | Frankreich |
| Italien (Republik) Regs | Treasuries | 1,05 % | Italien |
| Italien (Republik) | Treasuries | 1,03 % | Italien |
| Caisse Amortissement De La Dette S Regs | Agency | 1,01 % | Frankreich |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

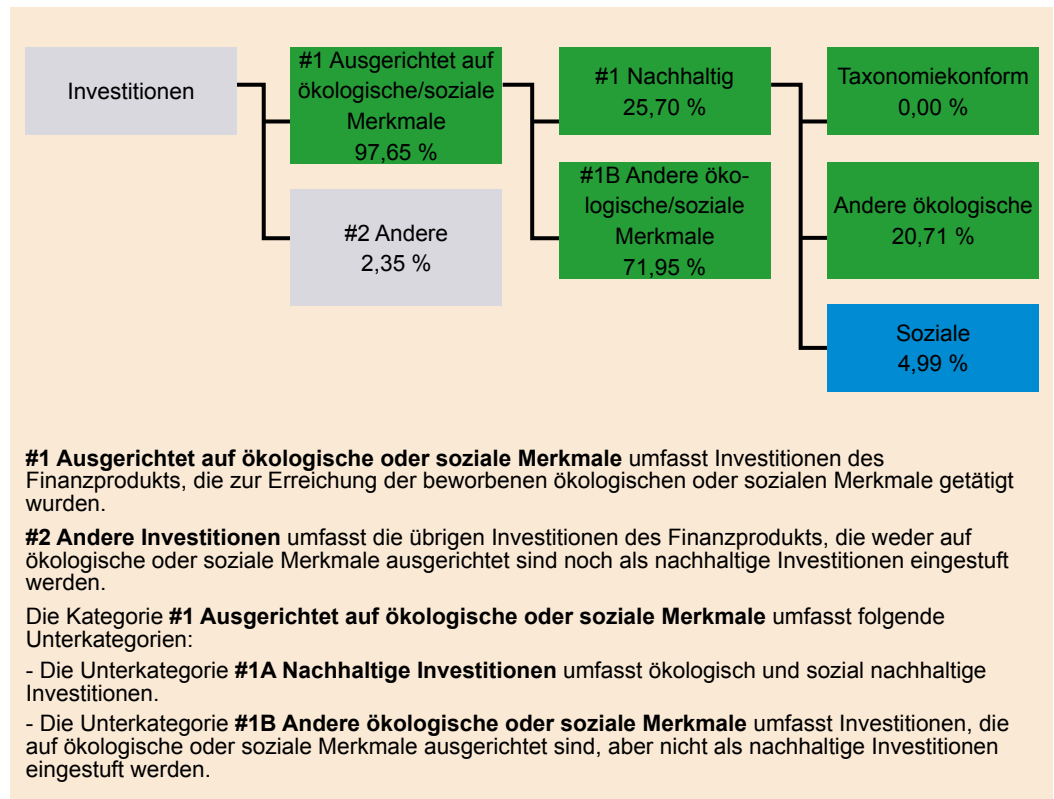
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|------------------|-----------------------------|---------------------|
| Treasuries | Treasuries | 40,56 % |
| Finanzinstitute | Bankwesen | 19,68 % |
| Gedekte Anleihen | Mortgage Collateralized | 11,61 % |
| Agency | Staatlich garantiert | 5,35 % |
| ABS | Sonstige | 3,69 % |
| Finanzinstitute | Finanzunternehmen | 3,52 % |
| Versorger | Strom | 2,58 % |
| Industrie | Zyklische Konsumgüter | 1,51 % |
| Staatsanleihen | Staatsanleihen | 1,28 % |
| CMBS | Nicht-staatliche CMBS | 1,24 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 1,22 % |
| Industrie | Nicht zyklische Konsumgüter | 1,17 % |
| Industrie | Technologie | 1,17 % |
| Industrie | Integriert | 0,43 % |

Während des Referenzzeitraums wurden keine der Anlagen des Fonds in den folgenden Teilsektoren (gemäß der Definition im Barclays Industry Classification System) gehalten: unabhängige, Midstream, Ölfeld-Dienstleistungen, Veredelung oder Metalle und Bergbau

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

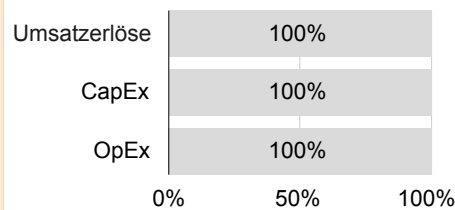
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja:
 - In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

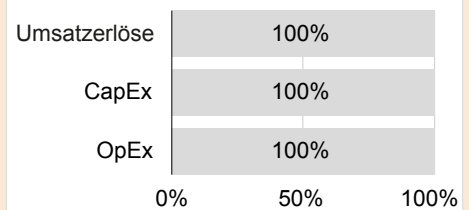
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 20,71 % der Investitionen des Fonds als nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel klassifiziert.

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die aus den folgenden Gründen nicht mit der EU-Taxonomie konform waren: (i) sie sind Teil der Anlagestrategie des Fonds; (ii) Daten zur Bestimmung der Konformität mit der EU-Taxonomie waren nicht verfügbar; und/oder (iii) die zugrunde liegenden Wirtschaftsaktivitäten waren nicht im Rahmen der verfügbaren technischen Screening-Kriterien der EU-Taxonomie zulässig oder erfüllten nicht alle Anforderungen dieser technischen Screening-Kriterien.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 4,99 % der Investitionen des Fonds als sozial nachhaltige Investitionen klassifiziert.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Barmittel, Derivate oder festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldtitel bezeichnet) umfassen, die von Regierungen und staatlichen Stellen auf der ganzen Welt ausgegeben werden, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachen. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Euro Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300JR73QQQMBLHT55

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%**
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 32,71 % an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Anlage in nachhaltigen Investitionen

Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen

Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben, zu mindestens 20 %

Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben

Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen

Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus der direkten Beteiligung an der Produktion von Nuklearwaffen oder Nuklearwaffenkomponenten oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Hilfsdienstleistungen im Zusammenhang mit Nuklearwaffen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakerzeugnisse herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel und der Lieferung von Tabakerzeugnissen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den Einzelhandel mit Zivilpersonen herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Vertrieb (Groß- oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den zivilen Gebrauch erzielen

Ausschluss von Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben (welche die Bereiche Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung umfassen)

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|-----------------------------------|
| Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben, zu mindestens 20 % | % der vom Fonds gehaltenen Anlagen, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben | 63,72 % |
| Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage von Ausschlusskriterien, wie in der obigen Tabelle „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Anlage in nachhaltigen Investitionen | % der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen | 32,71 % ¹ |
| Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen | % der vom Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen | 11,39 % |

¹ Mit Wirkung zum 29. Dezember 2022 hat sich der Fonds verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten. Daher wird dieser Prozentsatz anhand von Daten vom 29. Dezember 2022 bis zum 31. Mai 2023 dargestellt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Im Referenzzeitraum legte der Fonds 32,71 % seiner Bestände in nachhaltigen Investitionen an, um sein Anlageziel zu erreichen.

Umwelt- und soziale Ziele

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die zu einer Reihe von ökologischen und/oder sozialen Zielen beigetragen haben, zu denen unter anderem alternative und erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vermeidung oder Minderung von Umweltverschmutzung, Wiederverwendung und Recycling, Gesundheit, Ernährung, Sanitärversorgung und Bildung sowie die Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung und andere nachhaltigkeitsbezogene Rahmenwerke („Umwelt- und soziale Ziele“) gehören können.

Bewertung der wirtschaftlichen Aktivität

Eine Investition wurde als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet, wenn:
(i) ein Mindestanteil der Geschäftsaktivität des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen hat; oder die Geschäftspraktiken des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen haben; oder
(ii) die Verwendung der Erlöse („Use-of-Proceeds“) als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet wurde, beispielsweise grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen; oder
(iii) die festverzinslichen Wertpapiere auf ein Umwelt- und/oder soziales Ziel ausgerichtet waren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die vom Fonds während des Referenzzeitraums gehaltenen nachhaltigen Investitionen erfüllten die Anforderungen des Grundsatzes der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („DNSH“) gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften. BlackRock hat eine Reihe von Kriterien für alle nachhaltigen Investitionen entwickelt, um zu beurteilen, ob ein Emittent oder eine Investition ein Ziel erheblich beeinträchtigt. Investitionen, von denen angenommen wird, dass sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren für jede Anlageart wurden mithilfe der proprietären Methodik von BlackRock für nachhaltige Investitionen bewertet. Alle relevanten obligatorischen PAI-Indikatoren in Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 22/1288 der Kommission wurden berücksichtigt. BlackRock nutzt Fundamentalanalysen und/oder Datenquellen Dritter, um Investitionen zu identifizieren, die sich nachteilig auf Nachhaltigkeitsfaktoren auswirken und erhebliche Beeinträchtigungen verursachen. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

Die im Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen wie grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen entsprechen den ICMA Green Bond Principles, ICMA Social Bond Principles oder gegebenenfalls den ICMA Sustainability Bond Guidelines. Die meisten PAI werden auf Emissionsebene für „Use-of-Proceeds“-Anleihen berücksichtigt, mit Ausnahme der Beteiligung an umstrittenen Waffen und der Verletzung des UN Global Compact oder der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, die auf Emittentenebene bewertet werden.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Nachhaltige Investitionen, die während des Referenzzeitraums gehalten wurden, wurden unter Berücksichtigung etwaiger nachteiliger Auswirkungen und unter Einhaltung der internationalen Standards der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und der UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte beurteilt, einschließlich der Grundsätze und Rechte, die in den acht Grundsatzkonventionen gemäß der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO) über die grundlegenden Prinzipien und Rechte bei der Arbeit und in der Internationalen Menschenrechtscharta festgelegt sind. Emittenten, die mutmaßlich gegen diese Konventionen verstoßen haben, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | Nachhaltigkeitsindikator | | | | | |
|--|---|---|--|---|--|--------------------------------------|
| | Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben | Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung von Waffen (unter anderem einschließlich biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten | Ausschluss von Emittenten, die an Verstößen gegen den UN Global Compact beteiligt waren, ermittelt durch MSCI oder einen anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageberater jeweils nutzt | Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen |
| Treibhausgasemissionen (THG) | | | | | | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | | | | | | P |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | | | P | P | | |
| Energieverbrauchsintensität pro Sektor mit hoher Klimabelastung | P | | | | | |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

| | |
|---|---|
| Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | P |
| Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen) | F |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|-----------------|-------------------------|--------------------------------|
| Credit Suisse Group Ag Mtn Regs | Finanzinstitute | 1,15 % | Schweiz |
| Repsol International Finance Bv Regs | Industrie | 1,13 % | Niederlande |
| Barclays Plc Mtn Regs | Finanzinstitute | 1,03 % | Vereinigtes Königreich |
| Ubs Group Ag Mtn Regs | Finanzinstitute | 1,02 % | Schweiz |
| Eni Spa Nc6 Regs | Industrie | 0,88 % | Italien |
| Total Se Pnc7 Mtn Regs | Industrie | 0,88 % | Frankreich |
| Santander Uk Group Holdings Plc Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,88 % | Vereinigtes Königreich |
| Swedbank Ab Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,86 % | Schweden |
| Morgan Stanley Mtn | Finanzinstitute | 0,84 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Erste Bank Hungary Zrt Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,84 % | Ungarn |
| General Motors Financial Co Inc Mtn Regs | Industrie | 0,81 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Hsbc Holdings Plc Regs | Finanzinstitute | 0,81 % | Vereinigtes Königreich |
| Teleperformance Mtn Regs Industrial | Industrie | 0,80 % | Frankreich |
| Bayer Ag Nc8.5 Regs | Industrie | 0,80 % | Deutschland |
| Dbs Group Holdings Ltd Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,74 % | Singapur |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

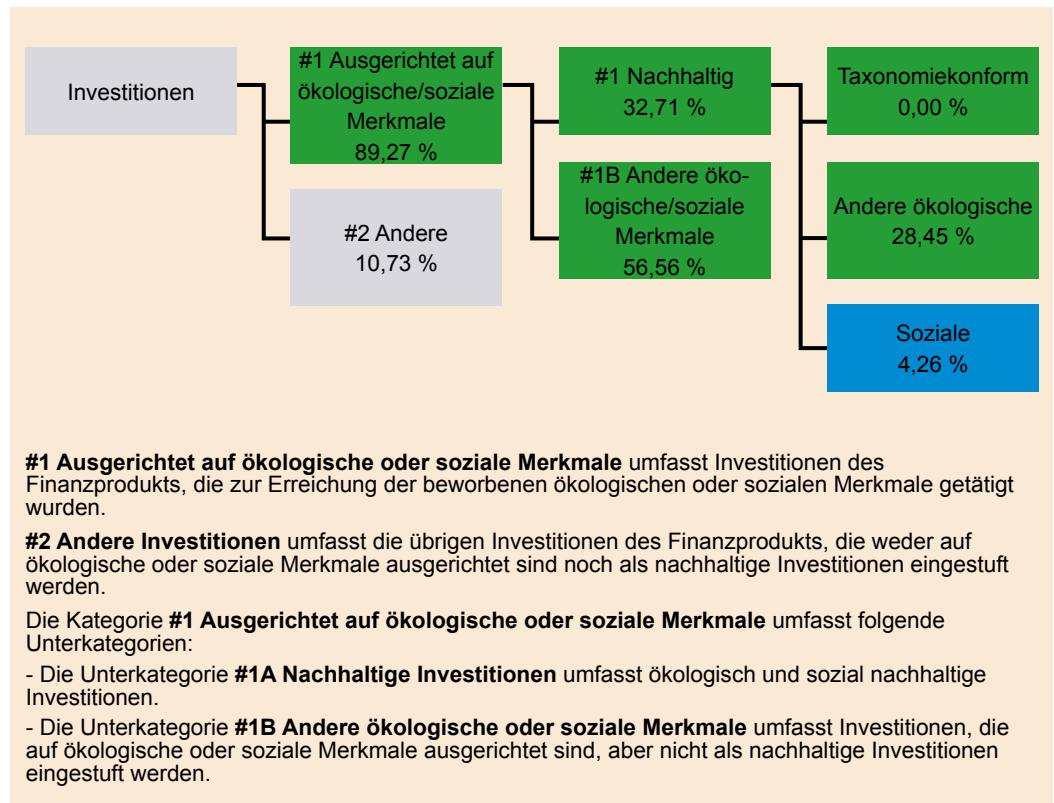
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|------------------------|--------------------------------------|---------------------|
| Finanzinstitute | Bankwesen | 42,40 % |
| Industrie | Kommunikation | 6,19 % |
| Sonstige | Sonstige | 5,25 % |
| Industrie | Integriert | 4,65 % |
| Versorger | Strom | 4,52 % |
| Industrie | Nicht zyklische Konsumgüter | 4,17 % |
| Finanzinstitute | Versicherung | 3,29 % |
| Industrie | Zyklische Konsumgüter | 3,24 % |
| Versorger | Erdgas | 2,62 % |
| Agency | Owned No Guarantee | 2,42 % |
| Lokale Behörde | Lokale Behörde | 2,24 % |
| Industrie | Technologie | 2,07 % |
| Finanzinstitute | Finanzunternehmen | 2,00 % |
| Treasuries | Treasuries | 1,92 % |
| Gepoolte Investitionen | Gepoolte Investitionen | 1,77 % |
| Industrie | Chemikalien | 1,53 % |
| Finanzinstitute | REITs | 1,39 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 1,32 % |
| Finanzinstitute | Makler/Vermögens verwalter/Börsen | 1,24 % |
| Gedekte Anleihen | Mortgage Collateralized | 1,22 % |
| Staatliche Wertpapiere | Staatliche Wertpapiere | 1,20 % |
| Industrie | Metalle und Bergbau | 0,45 % |
| Industrie | Unabhängig | 0,07 % |

Während des Referenzzeitraums wurde keine der Investitionen des Fonds in den folgenden Teilsektoren (gemäß Definition im Barclays Industry Classification System) gehalten: Midstream, Ölfeld-Dienstleistungen, Veredelung.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

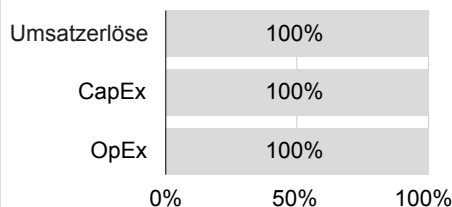
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

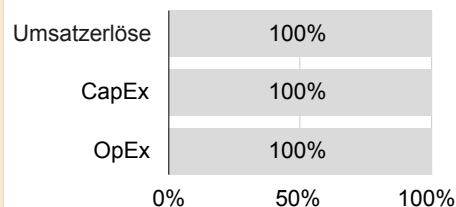
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 28,45 % der Investitionen des Fonds als nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel klassifiziert.

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die aus den folgenden Gründen nicht mit der EU-Taxonomie konform waren: (i) sie sind Teil der Anlagestrategie des Fonds; (ii) Daten zur Bestimmung der Konformität mit der EU-Taxonomie waren nicht verfügbar; und/oder (iii) die zugrunde liegenden Wirtschaftsaktivitäten waren nicht im Rahmen der verfügbaren technischen Screening-Kriterien der EU-Taxonomie zulässig oder erfüllten nicht alle Anforderungen dieser technischen Screening-Kriterien.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 4,26 % der Investitionen des Fonds als sozial nachhaltige Investitionen klassifiziert.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Barmittel, Derivate oder festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldtitel bezeichnet) umfassen, die von Regierungen und staatlichen Stellen auf der ganzen Welt ausgegeben werden, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachen. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Credit Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300NET6YB688UCO80

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja
 Nein

| | |
|---|---|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 26,89 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |
|---|---|



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Anlage in nachhaltigen Investitionen

Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen

Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben, zu mindestens 20 %

Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben

Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspißende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen

Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus der direkten Beteiligung an der Produktion von Nuklearwaffen oder Nuklearwaffenkomponenten oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Hilfsdienstleistungen im Zusammenhang mit Nuklearwaffen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakerzeugnisse herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel und der Lieferung von Tabakerzeugnissen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den Einzelhandel mit Zivilpersonen herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Vertrieb (Groß- oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den zivilen Gebrauch erzielen

Ausschluss von Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben (welche die Bereiche Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung umfassen)

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|--|-----------------------------------|
| Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen | % der vom Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen | 13,83 % |
| Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben, zu mindestens 20 % | % der vom Fonds gehaltenen Anlagen, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben | 49,41 % |
| Begrenzung von Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie negative externe Effekte haben | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage von Ausschlusskriterien, wie in der obigen Tabelle „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |
| Anlage in nachhaltigen Investitionen | % der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen | 26,89 % ¹ |

¹ Mit Wirkung zum 29. Dezember 2022 hat sich der Fonds verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten. Daher wird dieser Prozentsatz anhand von Daten vom 29. Dezember 2022 bis zum 31. Mai 2023 dargestellt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Im Referenzzeitraum legte der Fonds 26,89 % seiner Bestände in nachhaltigen Investitionen an, um sein Anlageziel zu erreichen.

Umwelt- und soziale Ziele

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die zu einer Reihe von ökologischen und/oder sozialen Zielen beigetragen haben, zu denen unter anderem alternative und erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vermeidung oder Minderung von Umweltverschmutzung, Wiederverwendung und Recycling, Gesundheit, Ernährung, Sanitärversorgung und Bildung sowie die Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung und andere nachhaltigkeitsbezogene Rahmenwerke („Umwelt- und soziale Ziele“) gehören können.

Bewertung der wirtschaftlichen Aktivität

Eine Investition wurde als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet, wenn:
(i) ein Mindestanteil der Geschäftsaktivität des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen hat; oder die Geschäftspraktiken des Emittenten zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beigetragen haben; oder
(ii) die Verwendung der Erlöse („Use-of-Proceeds“) als Beitrag zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel bewertet wurde, beispielsweise grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen; oder
(iii) die festverzinslichen Wertpapiere auf ein Umwelt- und/oder soziales Ziel ausgerichtet waren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die vom Fonds während des Referenzzeitraums gehaltenen nachhaltigen Investitionen erfüllten die Anforderungen des Grundsatzes der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („DNSH“) gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften. BlackRock hat eine Reihe von Kriterien für alle nachhaltigen Investitionen entwickelt, um zu beurteilen, ob ein Emittent oder eine Investition ein Ziel erheblich beeinträchtigt. Investitionen, von denen angenommen wird, dass sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren für jede Anlageart wurden mithilfe der proprietären Methodik von BlackRock für nachhaltige Investitionen bewertet. Alle relevanten obligatorischen PAI-Indikatoren in Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 22/1288 der Kommission wurden berücksichtigt. BlackRock nutzt Fundamentalanalysen und/oder Datenquellen Dritter, um Investitionen zu identifizieren, die sich nachteilig auf Nachhaltigkeitsfaktoren auswirken und erhebliche Beeinträchtigungen verursachen. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

Die im Fonds gehaltenen „Use-of-Proceeds“-Anleihen wie grüne Anleihen, soziale Anleihen und Nachhaltigkeitsanleihen entsprechen den ICMA Green Bond Principles, ICMA Social Bond Principles oder gegebenenfalls den ICMA Sustainability Bond Guidelines. Die meisten PAI werden auf Emissionsebene für „Use-of-Proceeds“-Anleihen berücksichtigt, mit Ausnahme der Beteiligung an umstrittenen Waffen und der Verletzung des UN Global Compact oder der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen, die auf Emittentenebene bewertet werden.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Nachhaltige Investitionen, die während des Referenzzeitraums gehalten wurden, wurden unter Berücksichtigung etwaiger nachteiliger Auswirkungen und unter Einhaltung der internationalen Standards der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und der UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte beurteilt, einschließlich der Grundsätze und Rechte, die in den acht Grundsatzkonventionen gemäß der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO) über die grundlegenden Prinzipien und Rechte bei der Arbeit und in der Internationalen Menschenrechtscharta festgelegt sind. Emittenten, die mutmaßlich gegen diese Konventionen verstoßen haben, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | Nachhaltigkeitsindikator | | | | | |
|--|---|---|--|---|--|--------------------------------------|
| | Anlagen in Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie positive externe Effekte haben | Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung von Waffen (unter anderem einschließlich biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten | Ausschluss von Emittenten, die an Verstößen gegen den UN Global Compact beteiligt waren, ermittelt durch MSCI oder einen anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageberater jeweils nutzt | Anlage in „Use-of-Proceeds“-Anleihen |
| Treibhausgasemissionen (THG) | | | | | | P |
| THG-Intensität der Beteiligungsunternehmen | | | | | | P |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | | | P | P | | |
| Energieverbrauchsintensität pro Sektor mit hoher Klimabelastung | P | | | | | |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

| | |
|---|---|
| Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | P |
| Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen) | F |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|-------------------------|-------------------------|--------------------------------|
| Zypern (Republik) Mtn Regs | Treasuries | 1,01 % | Zypern |
| Europäische Investitionsbank MTN REGS | Supranationale Anleihen | 0,98 % | Supranationale Anleihen |
| Barsicherheiten EUR XMLE | Finanzinstitute | 0,91 % | Europäische Union |
| Finnland (Republik) | Treasuries | 0,89 % | Finnland |
| Montenegro (Republik) Regs | Staatsanleihen | 0,86 % | Montenegro, Republik |
| Neuseeland (Regierung) Regs | Treasuries | 0,81 % | Neuseeland |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität Regs | Supranationale Anleihen | 0,81 % | Supranationale Anleihen |
| Belgien (Königreich) | Treasuries | 0,69 % | Belgien |
| Europäische Investitionsbank REGS | Staatliche Wertpapiere | 0,65 % | Supranationale Anleihen |
| Banco Santander Sa Regs | Gedekte Anleihen | 0,65 % | Spanien |
| Danske Bank A/S Mtn Regs | Finanzinstitute | 0,64 % | Dänemark |
| Kfw Mtn Regs | Agency | 0,62 % | Deutschland |
| Deriv Eur Balance With R67675 Luk | Finanzinstitute | 0,61 % | Europäische Union |
| Barsicherheiten Eur Xbaml | Finanzinstitute | 0,58 % | Europäische Union |
| Nextera Energy Operating Partners 144A | Versorger | 0,56 % | Vereinigte Staaten von Amerika |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

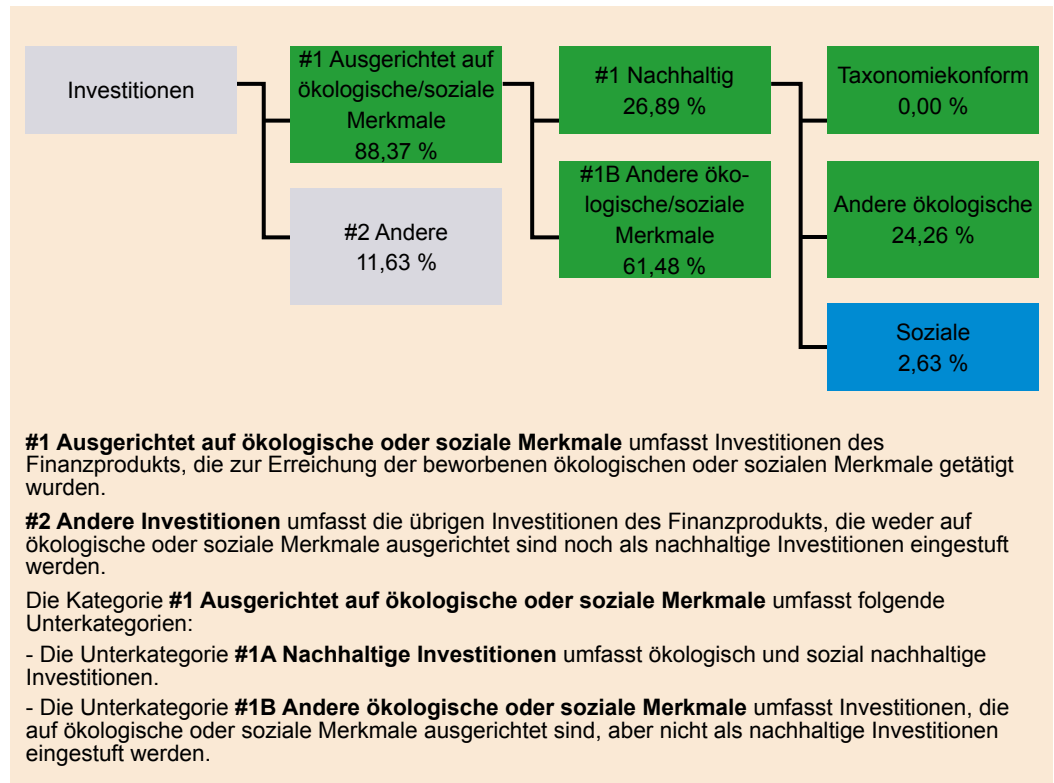
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|------------------------|----------------------------------|---------------------|
| Finanzinstitute | Bankwesen | 24,04 % |
| Industrie | Treasuries | 8,99 % |
| ABS | Sonstige | 8,26 % |
| Gedekte Anleihen | Mortgage Collateralized | 5,39 % |
| Staatliche Wertpapiere | Staatliche Wertpapiere | 5,19 % |
| Finanzinstitute | Finanzunternehmen | 4,03 % |
| Agency | Staatlich garantiert | 4,01 % |
| Sonstige | Sonstige | 3,85 % |
| Versorger | Strom | 3,61 % |
| Staatsanleihen | Staatsanleihen | 3,52 % |
| Agency | Owned No Guarantee | 3,09 % |
| Industrie | Kommunikation | 3,06 % |
| Finanzinstitute | Makler/Vermögensverwalter/Börsen | 3,00 % |
| Industrie | Zyklische Konsumgüter | 2,52 % |
| CMBS | Nicht-staatliche CMBS | 2,49 % |
| Lokale Behörde | Lokale Behörde | 1,98 % |
| ABS | Auto-besichert | 1,58 % |
| Industrie | Transportwesen | 1,52 % |
| Industrie | Nicht zyklische Konsumgüter | 1,51 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 1,07 % |
| Finanzinstitute | Versicherung | 1,03 % |
| Industrie | Integriert | 0,49 % |
| Industrie | Metalle und Bergbau | 0,22 % |
| Industrie | Midstream | 0,21 % |
| Industrie | Unabhängig | 0,05 % |
| Industrie | Veredelung | 0,02 % |

Während des Referenzzeitraums wurde keine der Investitionen des Fonds in den folgenden Teilsektoren (gemäß Definition im Barclays Industry Classification System) gehalten: Ölfeld-Dienstleistungen.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

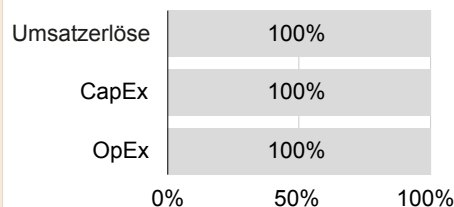
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 24,26 % der Investitionen des Fonds als nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel klassifiziert.

Der Fonds investierte in nachhaltige Investitionen, die aus den folgenden Gründen nicht mit der EU-Taxonomie konform waren: (i) sie sind Teil der Anlagestrategie des Fonds; (ii) Daten zur Bestimmung der Konformität mit der EU-Taxonomie waren nicht verfügbar; und/oder (iii) die zugrunde liegenden Wirtschaftsaktivitäten waren nicht im Rahmen der verfügbaren technischen Screening-Kriterien der EU-Taxonomie zulässig oder erfüllten nicht alle Anforderungen dieser technischen Screening-Kriterien.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 2,63 % der Investitionen des Fonds als sozial nachhaltige Investitionen klassifiziert.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Barmittel, Derivate oder festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldtitel bezeichnet) umfassen, die von Regierungen und staatlichen Stellen auf der ganzen Welt ausgegeben werden, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachen. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300PDYGVK3QI5Z550

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%**
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - mit einem sozialen Ziel

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Verkaufsprospekt des Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen

Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus der direkten Beteiligung an der Produktion von Nuklearwaffen oder Nuklearwaffenkomponenten oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Hilfsdienstleistungen im Zusammenhang mit Nuklearwaffen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakerzeugnisse herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel und der Lieferung von Tabakerzeugnissen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den Einzelhandel mit Zivilpersonen herstellen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Vertrieb (Groß- oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Kleinwaffenmunition für den zivilen Gebrauch erzielen

Ausschluss von Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben (welche die Bereiche Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung umfassen)

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren, die verwendet werden, um die Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wie im Verkaufsprospekt des Fonds näher beschrieben.

| Nachhaltigkeitsindikator | Kennzahl | Leistung für den Referenzzeitraum |
|---|------------------------|-----------------------------------|
| Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage von Ausschlusskriterien, wie in der obigen Tabelle „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“ | # der aktiven Verstöße | Keine aktiven Verstöße |

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte lesen Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem dargelegt ist, wie der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

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.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch die Anwendung dieser Mindest-ESG- und Ausschlusskriterien. Der Anlageberater hat beschlossen, dass die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI), die in der nachstehenden Tabelle als „F“ gekennzeichnet sind, im Rahmen der Anlageauswahlkriterien vollständig und mit „P“ gekennzeichnete PAI teilweise berücksichtigt werden. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird teilweise berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator teilweise der regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards („RTS“) dargelegt ist. Eine wesentliche nachteilige Auswirkung (PAI) wird vollständig berücksichtigt, wenn eine interne Bewertung von BlackRock festgestellt hat, dass der Nachhaltigkeitsindikator der vollständigen regulatorischen Definition der PAI entspricht, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 im Hinblick auf RTS dargelegt ist.

| Negativer Nachhaltigkeitsindikator | Nachhaltigkeitsindikator | | | |
|---|---|--|---|--|
| | Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen (unter anderem einschließlich Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht aufzuspürende Fragmente und/oder Brandwaffen) beteiligt sind oder anderweitig Bezug zu diesen aufweisen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen | Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf Kraftwerkskohlebasis erzielen, ausgenommen „grüne Anleihen“ von solchen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie die Grundsätze für grüne Anleihen der International Capital Markets Association einhalten | Ausschluss von Emittenten, die an Verstößen gegen den UN Global Compact beteiligt waren, ermittelt durch MSCI oder einen anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageberater jeweils nutzt |
| Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind | P | P | | |
| Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | | | P | |
| Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen) | | | | F |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 1. Juni 2022 bis 31. Mai 2023.

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------------|
| Apple Inc | Informationstechnologie | 5,28 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Microsoft Corp | Informationstechnologie | 4,34 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Amazon Com Inc | Nicht-Basiskonsumgüter | 1,70 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Alphabet Inc Class A | Kommunikation | 1,45 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Unitedhealth Group Inc | Gesundheitsversorgung | 1,33 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Nvidia Corp | Informationstechnologie | 1,26 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Johnson & Johnson | Gesundheitsversorgung | 1,15 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Home Depot Inc | Nicht-Basiskonsumgüter | 1,09 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Pepsico Inc | Basiskonsumgüter | 1,08 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Chevron Corp | Energie | 1,05 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Meta Platforms Inc Class A | Kommunikation | 1,03 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Tesla Inc | Nicht-Basiskonsumgüter | 1,03 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Exxon Mobil Corp | Energie | 0,99 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Bristol Myers Squibb | Gesundheitsversorgung | 0,94 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Adobe Inc | Informationstechnologie | 0,93 % | Vereinigte Staaten von Amerika |

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

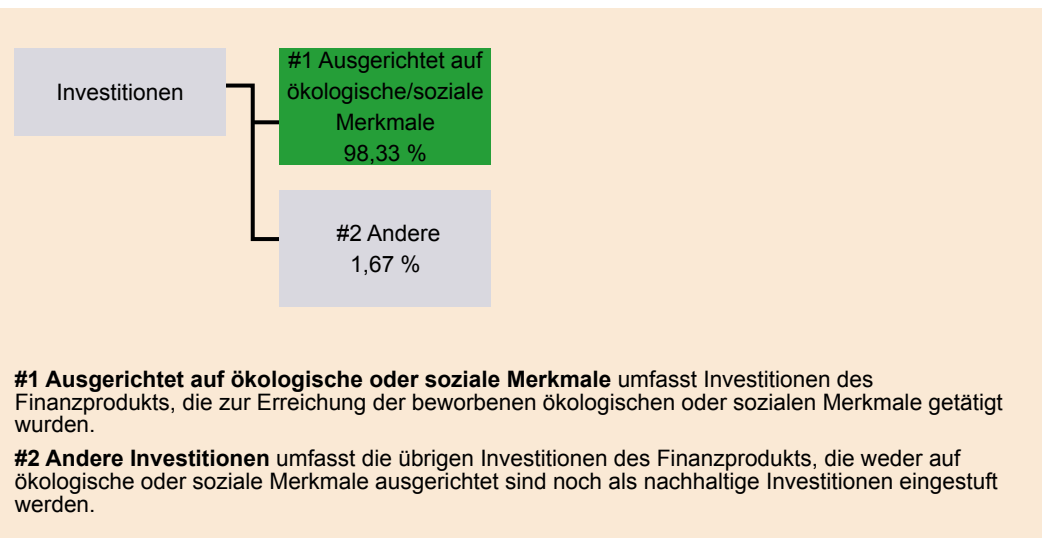
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in denen der Fonds während des Referenzzeitraums engagiert war.

| Sektor | Teilsektor | % der Investitionen |
|-------------------------|--|---------------------|
| Informationstechnologie | Software und Services | 11,65 % |
| Gesundheitsversorgung | Pharmaindustrie, Biotechnologie & Biowissenschaften | 9,43 % |
| Informationstechnologie | Technische Hardware und Ausrüstung | 7,26 % |
| Industrie | Investitionsgüter | 6,97 % |
| Gesundheitsversorgung | Ausrüstung und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen | 5,45 % |
| Kommunikation | Medien und Unterhaltung | 5,28 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Nicht-Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel | 4,92 % |
| Finanzwesen | Banken | 4,84 % |
| Basiskonsumgüter | Lebensmittel Getränke Tabak | 4,50 % |
| Informationstechnologie | Halbleiter und Halbleiterausrüstung | 4,47 % |
| Finanzwesen | Finanzdienstleistungen | 3,97 % |
| Finanzwesen | Versicherung | 3,54 % |
| Werkstoffe | Werkstoffe | 3,13 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Fahrzeuge & Fahrzeugteile | 2,92 % |
| Energie | Integrierte Öl- und Gasindustrie | 2,69 % |
| Immobilien | Equity Real Estate Investment Trusts (REITs) | 2,27 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Langlebige Konsumgüter | 2,16 % |
| Versorger | Versorger | 2,09 % |
| Basiskonsumgüter | Haushalts- & Persönliche Produkte | 1,75 % |
| Nicht-Basiskonsumgüter | Verbraucherdienste | 1,64 % |
| Basiskonsumgüter | Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel | 1,49 % |
| Industrie | Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen | 1,43 % |
| Energie | Öl- und Gasexploration und -produktion | 1,21 % |
| Kommunikation | Telekommunikation | 1,09 % |
| Industrie | Transportwesen | 1,06 % |
| Energie | Veredelung und Vermarktung von Öl und Gas | 0,46 % |
| Energie | Öl- und Gaslagerung und -transport | 0,39 % |
| Energie | Öl- und Gasanlagen und -dienstleistungen | 0,17 % |
| Energie | Öl- und Gasbohrung | 0,01 % |

Während des Referenzzeitraums wurde keine der Investitionen des Fonds in den folgenden Teilsektoren (gemäß Definition im Global Industry Classification System) gehalten: Kohle und verbrauchbare Brennstoffe.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie ist für den Referenzzeitraum in den nachstehenden Diagrammen dargestellt.

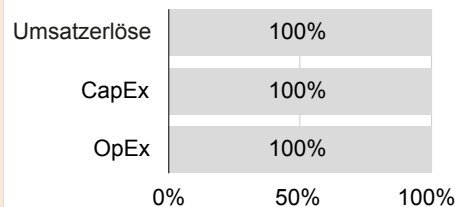
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten in Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja:
 - In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

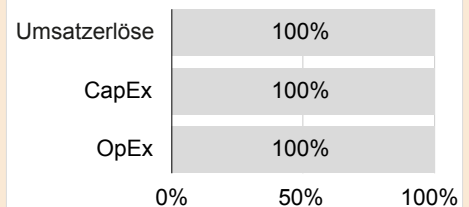
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

In Bezug auf den Referenzzeitraum flossen 0 % der Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Referenzzeitraum handelt, in dem die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten in Kraft treten, werden keine Vergleichszahlen dargestellt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt gilt nicht für diesen Fonds, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Referenzzeitraums nachhaltige Investitionen zu halten. Bestimmte nachhaltige Investitionen können jedoch Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Anlagen können Barmittel und Derivate umfassen, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachten. Solche Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des Anlageziels des Fonds (Nicht-ESG), zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder der Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz bewertet.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen implementiert, wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten identifiziert werden, die potenziell Probleme in Bezug auf eine gute Unternehmensführung aufweisen, werden die Emittenten überprüft, um – sofern der Anlageberater mit dieser externen Beurteilung einverstanden ist – sicherzustellen, dass der Anlageberater davon überzeugt ist, dass der Emittent entweder Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums basierend auf der direkten Zusammenarbeit des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

Der Anlageberater unterliegt zudem den Anforderungen an die Einbeziehung von Anteilhabern gemäß der Aktionärsrechterichtlinie II (SRD). Ziel der SRD ist die Stärkung der Position der Anteilhaber, die Verbesserung der Transparenz und die Verringerung exzessiver Risiken innerhalb von Unternehmen, die auf regulierten EU-Märkten gehandelt werden. Weitere Einzelheiten zu den Tätigkeiten des Anlageberaters im Rahmen der SRD finden Sie auf der Webseite von BlackRock unter: <https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

BlackRock Strategic Funds

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten



Bei den

Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmen Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen; daher ist dieser Abschnitt nicht anwendbar.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Möchten Sie mehr erfahren?

blackrockinternational.com | +44 (0)20 7743 3000

© 2023 BlackRock, Inc. Alle Rechte vorbehalten. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS und iSHARES sind Marken von BlackRock, Inc. oder deren Tochtergesellschaften in den Vereinigten Staaten und anderen Ländern. Alle anderen Marken sind Eigentum der jeweiligen Rechteinhaber.

BlackRock

Go paperless. . . 
It's Easy, Economical and Green!
Go to www.blackrock.com/edelivery