

BlackRock

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss

BlackRock UCITS Funds

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

NM0724U-3752176-1/238

BLACKROCK UCITS FUNDS

INHALT	Seite
Überblick	
Allgemeine Informationen	1
Hintergrund	3
Performance	
Bericht des Investmentmanagers	5
Governance (Unternehmensführung)	
Erklärung über die Aufgaben der Verwaltungsgesellschaft	19
Bericht des Treuhänders an die Anteilinhaber	20
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	21
Jahresabschluss	
Gewinn- und Verlustrechnung	24
Eigenkapitalveränderungsrechnung	28
Aufstellung der Veränderungen des Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	29
Bilanz	32
Anmerkungen zum Jahresabschluss	36
Aufstellung der Vermögenswerte	77
Zusätzliche Informationen und aufsichtsrechtliche Angaben (ungeprüft)	
Aufstellungen wesentlicher Käufe und Verkäufe (ungeprüft)	175
Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)	192
Transaktionen mit verbundenen Personen (ungeprüft)	193
Transaktionskosten (ungeprüft)	193
Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions) (ungeprüft)	193
Gesamtrisikoeexposition (ungeprüft)	193
Hebelwirkung (ungeprüft)	194
Vergütungsbericht (ungeprüft)	195
Effizientes Portfoliomanagement und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	199
Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen (ungeprüft)	206
Haftungsausschlüsse (ungeprüft)	235

Dieser Jahresbericht und geprüfte Jahresabschluss (der „Bericht und Abschluss“) können in andere Sprachen übersetzt werden. Diese Übersetzungen müssen dieselben Informationen enthalten und dieselbe Bedeutung haben wie der englischsprachige Bericht und Abschluss. Sofern zwischen dem englischsprachigen Bericht und Abschluss und dem Bericht und Abschluss in einer anderen Sprache an irgendeiner Stelle Unterschiede bestehen, ist der englischsprachige Bericht und Abschluss maßgeblich. Ausnahmsweise ist eine andere Sprache des Berichts und Abschlusses dann und insoweit maßgeblich, wie das Gesetz eines Hoheitsgebietes, in dem die Anteile vertrieben werden, dies für Klagen, die sich auf Veröffentlichungen in einem Bericht und Abschluss in einer anderen Sprache als Englisch beziehen, verlangt. Jegliche Streitigkeiten in Bezug auf die Bedingungen von Bericht und Abschluss, ungeachtet der Sprache des Berichts und Abschlusses, unterliegen irischem Recht und dessen Auslegung.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft

Rosemary Quinlan (Vorsitzende) (Irin)¹
Patrick Boylan (Ire)^{2/3}
Maria Ging (Irin)^{2/3}
Michael Hodson (Ire)¹
Enda McMahon (Ire)^{2/3}
Justin Mealy (Ire)^{2/3}
Adele Spillane (Irin)¹
Catherine Woods (Irin)¹

¹Nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

²Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

³Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe

Verwaltungsgesellschaft

BlackRock Asset Management Ireland Limited
1st Floor
2 Ballsbridge Park
Ballsbridge
Dublin 4, D04 YW83
Irland

Währungsabsicherungsmanager⁴

JPMorgan Chase Bank N.A.
25 Bank Street Canary Wharf
London, E14 5JP
Vereinigtes Königreich

Fondsverwalter, Register- und Transferstelle

J.P. Morgan Administration Services (Ireland) Limited
200 Capital Dock
79 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 RK57
Irland

Treuhänder

J.P. Morgan SE - Zweigniederlassung Dublin
200 Capital Dock
79 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 RK57
Irland

Sekretär der Verwaltungsgesellschaft

Apex Group Corporate Administration Services Ireland Limited
Floor 2, Block 5
Irish Life Centre
Abbey Street Lower
Dublin 1, D01 P767
Irland

Promoter, Investmentmanager, Vertriebsstelle und Vermittler für Wertpapierleihen

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

Unter-Investmentmanager⁵

BlackRock Financial Management, Inc.
55 East 52nd Street
New York
NY 10055
Vereinigte Staaten von Amerika

BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
400 Howard Street
San Francisco
California 94105
Vereinigte Staaten von Amerika

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

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

Unabhängige Abschlussprüfer

Ernst & Young
Block 1 Harcourt Centre
Harcourt Street
Dublin 2, D02 YA40
Irland

Rechtsberater für irisches Recht

Matheson LLP
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 ER296
Irland

Zahlstelle in Italien

Allfunds Bank, S.A.
con sede legale in Estafeta, 6 (La Moraleja)
Complejo Plaza de la Fuente, Ed. 3
28109 Alcobendas, Madrid (Spanien)
Esede secundaria in Via Bocchetto, 6
20123 Milan
Italien

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

Iccrea Banca S.p.A.
Via Lucrezia Romana, 41/47
00178 Rome
Italien

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

Zahlstelle in Schweden

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

BLACKROCK UCITS FUNDS

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Zahlstelle in der Schweiz

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

Vertreter in Dänemark

BlackRock (Niederlande) B.V., Zweigniederlassung Kopenhagen
Harbour House, Sundkrogsgade 21
Kopenhagen
DK- 2100
Dänemark

Vertreter in der Schweiz

BlackRock Asset Management Schweiz AG
Bahnhofstrasse 39
8001 Zürich
Schweiz

⁴Ausschließlich in Bezug auf die währungsgesicherten Anteilsklassen bestimmter Fonds.

⁵Ausschließlich für bestimmte Fonds.

Für Schweizer Anleger: Der Prospekt des Unternehmens, der Treuhandvertrag, die wesentlichen Informationen für den Anleger („KIID“), die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIP-KID“) sowie der aktuellste Jahresbericht und geprüfte Jahresabschluss bzw. der aktuellste Halbjahresbericht und ungeprüfte Halbjahresabschluss und eine detaillierte Aufstellung aller für den jeweiligen Fonds im Laufe des Geschäftsjahres gekauften und verkauften Anlagen sind beim Vertreter in der Schweiz auf Anfrage kostenfrei erhältlich.

Bitte beachten Sie, dass für die folgenden Fonds keine Anzeige zum Vertrieb der Anteile gemäß §310 Kapitalanlagegesetzbuch erfolgt ist: BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund, BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1, BlackRock Global Equity Selection Fund, BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund, BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund und FR Multi-Asset Fund. Daher dürfen Anteile dieser Fonds in der Bundesrepublik Deutschland nicht öffentlich vertrieben werden.

Das Unternehmen ist bei der Comisión Nacional de Mercado de Valores in Spanien ordnungsgemäß unter der Nummer 1646 eingetragen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

HINTERGRUND

BlackRock UCITS Funds (das „Unternehmen“) ist als offene Investmentgesellschaft (Unit Trust) organisiert und wurde am 29. Juni 2007 als Umbrellafonds nach den Gesetzen Irlands gegründet. Das Unternehmen wurde unter dem Treuhandvertrag vom 28. Juni 2007 zwischen BlackRock Asset Management Ireland Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) und J.P. Morgan SE - Zweigniederlassung Dublin (der „Treuhand“) gegründet und unterliegt dem geänderten und neu gefassten Treuhandvertrag vom 4. Dezember 2009 und ergänzenden Verträgen. Das Unternehmen ist als Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen den Fonds gemäß dem Unit Trusts Act von 1990 (der „Act“) zugelassen. Das Unternehmen wird entsprechend den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011, in der jeweils gültigen Fassung, (die „OGAW-Vorschriften“) durch die irische Zentralbank („CBI“) zugelassen und überwacht.

Das Unternehmen ist als Umbrellafonds organisiert und besteht aus separaten Fonds („Fonds“) des Unternehmens. Die Anteile der einzelnen Fonds können in verschiedene Anteilklassen eingeteilt werden (jeweils eine „Anteilklasse“). Jeder Fonds repräsentiert ein separates Portfolio von Vermögenswerten und kann sich aus einer oder mehreren Anteilklassen zusammensetzen. Für die jeweiligen Anteilklassen können verschiedene Zeichnungs- und Rücknahmebestimmungen, Gebühren, Kosten oder Brokerage-Arrangements gelten. Die Auflegung einer zusätzlichen Anteilklasse wird der CBI vorab mitgeteilt. Das für jeden Fonds geführte Vermögensportfolio wird gemäß den im Prospekt angegebenen Anlagezielen und -strategien der einzelnen Fonds angelegt. Das Vermögen jedes Fonds soll exklusiv zu diesem Fonds gehören, vom Vermögen anderer Fonds getrennt werden und nicht verwendet werden, um die Verbindlichkeiten oder Ansprüche gegen jeden anderen Fonds direkt oder indirekt abzulösen, und soll keinem derartigen Zweck zur Verfügung stehen.

Sollte ein Vermögenswert oder eine Verbindlichkeit des Unternehmens als keinem speziellen Fonds zuordenbar gelten, so kann die Verwaltungsgesellschaft frei bestimmen, auf welcher Grundlage solche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten auf die Fonds verteilt werden, und die Verwaltungsgesellschaft ist immer und gegebenenfalls dazu ermächtigt, besagte Grundlage zu verändern, dies etwa indem solche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten zwischen sämtlichen oder einigen Fonds im Verhältnis zu ihren Nettoinventarwerten („NIW“) aufgeteilt werden oder auf einer anderen, durch die Verwaltungsgesellschaft festgelegten Grundlage.

Der Begriff „Fonds“ oder „Finanzprodukt“ bezeichnet entweder einen Fonds oder mehrere Fonds des Unternehmens oder – wenn dies der Kontext erfordert – die Verwaltungsgesellschaft des jeweiligen Fonds oder deren Stellvertreter, der für den jeweiligen Fonds handelt. Die Bezeichnungen „BlackRock“ und „Investmentmanager“ werden je nach Kontext stellvertretend für die BlackRock Advisors (UK) Limited benutzt. Alle Verweise auf „rückkaufbare Anteile“ beziehen sich auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile, wenn Fondsanteile als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert werden. Die Bezeichnung „Verwaltungsratsmitglied“ bezeichnet die Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft.

Weitere Einzelheiten, einschließlich der Anlageziele und der Mindestzeichnungsanforderungen, sind im Prospekt des Unternehmens enthalten.

Details der Fonds

Zum 31. März 2024 waren 10 Fonds des Unternehmens geschäftstätig.

Die folgenden Fonds haben ihre Tätigkeit in den vorangegangenen Jahren eingestellt und müssen noch von der CBI widerrufen werden. Für die geschlossenen Fonds wurden keine geprüften Jahresabschlüsse erstellt, da diese Fonds keine Investitionen halten und die endgültigen geprüften Jahresabschlüsse in früheren Jahren erstellt wurden.

- BlackRock Diversified Distribution Fund
- BlackRock Diversified Strategies Selection Fund
- BlackRock Dynamic Allocation Fund
- BlackRock Euro Cash Fund
- BlackRock Fixed Income Selection Fund
- BlackRock Multi Style Strategy Fund und
- BlackRock Tactical Opportunities Fund

Veränderungen im Unternehmen im Laufe des Geschäftsjahres

Am 11. April 2023 wurde ein aktualisierter Prospekt für das Unternehmen herausgegeben, um Angaben zur Auflegung des BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 aufzunehmen.

Am 4. Mai 2023 änderte sich die Funktion von Adele Spillane von einem geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglied zu einem nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft.

Am 9. Mai 2023 nahm der BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 mit der Auflegung der Anteilklassen C CHF Hedged Accumulating, C CHF Hedged Distributing, C EUR Accumulating, C EUR Distributing, GBP Hedged Accumulating, C GBP Hedged Distributing, C USD Hedged Accumulating, C USD Hedged Distributing, D CHF Hedged Accumulating, D CHF Hedged Distributing, D EUR Accumulating, D EUR Distributing, D GBP Hedged Accumulating, D GBP Hedged Distributing, D USD Hedged Accumulating, D USD Hedged Distributing den Handel auf.

Am 12. Juni 2023 wurde für das Unternehmen ein aktualisierter Prospekt zur Berücksichtigung der folgenden Änderungen veröffentlicht:

- Aktualisierungen zu den Informationen über Verwaltungsratsmitglieder.
- Aktualisierungen bzgl. des Secretary der Verwaltungsgesellschaft.
- Aufnahme des BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1 in die Kriterien von Artikel 8 der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (Sustainable Finance Disclosure Regulation, „SFDR“).

Am 27. Juni 2023 wurde der BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund vollständig zurückgenommen.

Am 12. Juli 2023 wurden die Anteile der Klassen C GBP Hedged Accumulating, C GBP Hedged Distributing, D CHF Hedged Accumulating, D CHF Hedged Distributing, D GBP Hedged Accumulating, D GBP Hedged Distributing, D USD Hedged Accumulating und D USD Hedged Distributing für den BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 vollständig zurückgenommen.

Maria Ging wurde am 18. September 2023 zum geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft ernannt.

Am 30. Oktober 2023 wurde der BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 vollständig zurückgenommen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

HINTERGRUND (Fortsetzung)

Veränderungen im Unternehmen im Laufe des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Am 6. Dezember 2023 wurde der BlackRock UK Credit Screened Fund vollständig zurückgenommen.

Am 18. Januar 2024 wurde die Anteilklasse Institutional 2 Distributing des BlackRock Diversifying Fixed Income Fund vollständig zurückgenommen.

Am 20. März 2024 wurde der BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund vollständig zurückgenommen.

Am 29. März 2024 schied Graham Bamping als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft aus.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS

Anlageziel

BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Gesamrendite (in Form von Kapitalzuwachs und laufenden Erträgen) zu erwirtschaften, die der Rendite des MSCI All Country World TR Index (EUR) entspricht.

BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1

Das Anlageziel des Fonds ist die Erzielung einer Gesamrendite für die Anleger aus Kapitalwert und Rendite entsprechend der Rendite des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Index.

BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1

Das Anlageziel des Fonds war die Erzielung einer Gesamrendite für die Anleger aus Kapitalwert und Rendite entsprechend der Rendite des Barclays Euro Aggregate Treasury Bond Index.

BlackRock UK Credit Screened Fund

Das Anlageziel des Fonds bestand darin, den Anlegern ein breit gestreutes Engagement in Unternehmensanleihen zu bieten, bei denen es sich überwiegend um auf Pfund Sterling lautende festverzinsliche Wertpapiere handelte.

BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund

Das Anlageziel des Fonds ist es, über die Anlage in hauptsächlich festverzinsliche Wertpapiere einen Ertrag zu generieren und gleichzeitig das Kapital zu erhalten.

BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund

Das Anlageziel des Fonds bestand darin, den Anlegern ein breit gestreutes Engagement in erster Linie in den weltweiten Märkten für Staatsanleihen aus Industrieländern zu bieten.

BlackRock Diversifying Fixed Income Fund

Das Anlageziel des Fonds ist es, den Anlegern halbjährliche Erträge zu bieten und gleichzeitig eine langfristige Kapitalerhaltung anzustreben. Dies geschieht durch die Anlage in ein diversifiziertes Portfolio von Investmentfonds und/oder ein diversifiziertes Portfolio von festverzinslichen Wertpapieren.

BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund

BlackRock Global Equity Selection Fund

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, den Anlegern langfristig ein Kapitalwachstum zu bieten.

BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, den Anlegern langfristig ein Kapitalwachstum bei gleichzeitiger Wahrung eines moderaten Risikoniveaus zu bieten.

BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund

Das Anlageziel des Fonds besteht in der langfristigen Maximierung des Gesamtertrags bei gleichzeitiger Wahrung eines konservativen Risikoniveaus.

BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund

Das Anlageziel des Fonds war es, den Anlegern langfristig im Einklang mit den Grundsätzen für Investitionen mit Fokus auf Umwelt, Soziales und Governance („ESG“) Kapitalzuwachs zu bieten.

FR Multi-Asset Fund

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Gesamrendite in Form von Kapitalzuwachs und laufenden Erträgen zu erwirtschaften.

BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026

Das Anlageziel des Fonds besteht in der Erzielung von Erträgen bei gleichzeitiger Erhaltung des ursprünglich investierten Kapitals, wobei die Anlagen im Einklang mit Grundsätzen für Investitionen mit Fokus auf Umwelt, Soziales und Governance („ESG“) erfolgen.

Ansatz zum Investmentmanagement und ESG-Politik

In der folgenden Tabelle wird der für die einzelnen Fonds gewählte Ansatz zum Investmentmanagement dargelegt. Darüber hinaus zeigt sie, welche Fonds gemäß der EU-SFDR ökologische oder soziale Merkmale („Artikel-8-Fonds“) fördern oder nachhaltige Anlagen als Ziel haben („Artikel-9-Fonds“). Weitere Einzelheiten darüber, wie die Artikel 8- und Artikel 9-Fonds diese Merkmale und Ziele erreicht haben, finden Sie im ergänzenden Abschnitt zu den SFDR-Angaben im Jahresbericht.

Bei allen anderen Fonds, die nicht die SFDR-Kriterien für Fonds gemäß Artikel 8 oder 9 erfüllen, berücksichtigen die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Anlagen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Anlageverwalter hat Zugang zu einer Reihe von Datenquellen, einschließlich von Informationen zu den Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“), wenn er Entscheidungen über die Auswahl von Anlagen trifft. BlackRock berücksichtigt zwar ESG-Risiken für alle Portfolios, und diese Risiken können mit ökologischen oder sozialen Themen übereinstimmen, die mit den PAI verbunden sind, doch verpflichten sich die einzelnen Fonds nicht, sofern im Prospekt nicht anders angegeben, PAIs bei der Auswahl ihrer Anlagen zu berücksichtigen.

Name des Fonds	Benchmarkindex/ Performanceindikator	Ansatz zum Investmentmanagement	SFDR- Kriterien
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	MSCI All Country World NET TR Index (EUR)	Indexnachbildung - nicht nachbildend	Sonstige
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Index	Indexnachbildung - nicht nachbildend	Artikel 8

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Anlageziel (Fortsetzung)

Ansatz zum Investmentmanagement und ESG-Politik (Fortsetzung)

Name des Fonds	Benchmarkindex/ Performanceindikator	Ansatz zum Investment- management	SFDR- Kriterien
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹	Bloomberg Barclays Euro Aggregate Treasury Bond Index	Indexnachbildung - nicht nachbildend	Sonstige
BlackRock UK Credit Screened Fund ^{2/3}	iBoxx Sterling Corporate ex Tier 1 and Upper Tier 2 with a 2% issuer cap	Aktiv	Sonstige
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund ³	3 Month EURIBOR Index	Aktiv	Artikel 8
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ^{3/4}	Bloomberg Barclays Global Treasury Index (customised)	Aktiv	Sonstige
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund ³	3 Month EURIBOR Index	Aktiv	Sonstige
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund ³	MSCI Emerging Markets Index (Net)	Aktiv	Sonstige
BlackRock Global Equity Selection Fund ³	50% MSCI Europe Index and 50% MSCI All Country World ex Europe Index	Aktiv	Sonstige
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund ⁵	N/A	Aktiv	Sonstige
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund ⁵	N/A	Aktiv	Sonstige
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ^{3/6}	MSCI EM ex Fossil Fuels Index	Aktiv	Artikel 8
FR Multi-Asset Fund	25% MSCI All Country World with Developed Markets 100% Hedged to EUR Index, 25% MSCI All Country World Index and 50% Bloomberg Global Aggregate Index	Aktiv	Sonstige
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ⁷	k. A.	Aktiv	Artikel 8

¹Der Fonds wurde am 30. Oktober 2023 geschlossen.

²Der Fonds wurde am 6. Dezember 2023 geschlossen.

³Der/die in vorstehender Tabelle enthaltene Performanceindikator/Performancebenchmark wird lediglich zu Referenzzwecken angegeben. Weitere Einzelheiten entnehmen Sie bitte dem Prospekt.

⁴Der Fonds wurde am 20. März 2024 geschlossen.

⁵Für diesen Fonds wird kein Performanceindikator berechnet.

⁶Der Fonds wurde am 27. Juni 2023 geschlossen.

⁷Der Fonds wurde am 9. Mai 2023 aufgelegt.

Weitere Informationen zu den verwendeten Index-Anlagestrategien sind unten aufgeführt:

- Bei nicht nachbildenden Fonds zielt der Investmentmanagementansatz darauf ab, Übereinstimmung mit den Hauptrisikomerkmale des Benchmarkindex durch die Anlage in einem Portfolio zu erreichen, das überwiegend aus den im Benchmarkindex vertretenen Wertpapieren besteht. Das Ziel besteht darin, eine Rendite zu erwirtschaften, die möglichst genau dem Gesamtertrag des Benchmarkindex nach Abzug von Transaktionskosten und vor Abzug von Gebühren und sonstigen Kosten entspricht.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Performanceübersicht, Tracking-Differenz und Tracking Error

Die nachstehende Tabelle vergleicht die realisierte Performance des Fonds mit der Performance der entsprechenden Benchmark im Geschäftsjahr zum 31. März 2024. Sie zeigt darüber hinaus den erwarteten Tracking Error der Index-nachbildenden Fonds (der im Prospekt auf Ex-ante-Basis angegeben ist) in Relation zum tatsächlich realisierten Tracking Error der Fonds zum 31. März 2024.

Weitere Informationen zu den Performanceindikatoren und den verwendeten Berechnungsmethoden sind unten aufgeführt:

- Bei den aufgeführten Renditen handelt es sich um die Performance-Renditen für die primäre Anteilklasse der einzelnen Fonds, nach Abzug von Gebühren, die als repräsentative Anteilklasse ausgewählt wurde. Die primäre Anteilklasse stellt die Anteilklasse dar, in die die Mehrheit der Anleger des Fonds investiert. Sie berücksichtigt außerdem andere relevante Faktoren wie die Basiswährung des Fonds. Sofern nichts anderes angegeben ist, lauten die zu Vergleichszwecken angegebenen Erträge auf dieselbe Währung wie die primäre Anteilklasse. Die ausgewiesene Rendite der primären Anteilklasse kann von der im Jahresabschluss ausgewiesenen Gesamtpformance des Fonds für alle Anteilsklassen abweichen. Dies liegt in erster Linie an den Auswirkungen von Währungsumrechnungen und anteilklassenspezifischen Aufwendungen. Die Performance-Renditen für andere Anteilsklassen können auf Anfrage zur Verfügung gestellt werden.
- Für Fonds, die ihren Handel im Geschäftsjahr aufgenommen haben und/oder deren Anteile im Geschäftsjahr vollständig zurückgenommen wurden, werden die Renditen ab dem Datum angegeben, an dem der jeweilige Fonds den Handel aufnahm, und/oder ab dem Datum, an dem die Fondsanteile vollständig zurückgenommen wurden. Die Total Expense Ratio (Gesamtkostenquote, „TER“) ist die effektive TER ab dem Datum, an dem der Fonds den Handel aufgenommen hat und/oder bis zum Datum der vollständigen Rücknahme des Fonds.
- Die Fondsrenditen basieren auf dem gemäß dem Prospekt für das Geschäftsjahr berechneten NIW bei Wiederanlage der Dividende. Gemäß den Anforderungen des Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), die für die Abschlüsse gelten, kann es zu Abweichungen zwischen dem NIW je Anteil, wie im Abschluss ausgewiesen, und dem NIW je Anteil, der gemäß der im Prospekt ausgewiesenen Bewertungsmethode berechnet wird, kommen.
- Die Tracking-Differenz misst die Abweichung der Differenz der Erträge zwischen einem Fonds und seinem Benchmarkindex.
- Die TER jedes Fonds wird im gesamten Geschäftsjahr täglich abgegrenzt. Dies kann sich in Abhängigkeit von der Marktperformance und der angewandten TER-Quote positiv oder negativ auf den gemessenen Tracking Error auswirken. Die Höhe und das Ausmaß dieser Auswirkung auf die Performance-Messung sind abhängig vom Zeitpunkt der Marktperformance im Verhältnis zum Performance-Zeitraum des Fonds und können bei einem positiven Markt größer und bei einem negativen Markt kleiner sein als die Gesamt-TER. Die Gesamtkostenquote stellt die Summe aller Gebühren, Betriebskosten und Aufwendungen (mit Ausnahme direkter Handelskosten und Performance-Gebühren) dar, die dem Vermögen der einzelnen Fonds als Prozentsatz des durchschnittlichen Vermögens auf Basis des Zwölfmonatszeitraums zum 31. März 2024 belastet wird.
- Der erwartete Tracking Error basiert auf der erwarteten Volatilität der Differenz zwischen den Renditen eines Fonds und den Renditen seines Benchmarkindex.
- Der realisierte Tracking Error ist die jährliche Standardabweichung der Differenz zwischen den monatlichen Erträgen eines Fonds und seines Benchmarkindex. Der Tracking Error zeigt die Beständigkeit der Erträge im Verhältnis zum Benchmarkindex über einen festgelegten Zeitraum. Der realisierte Tracking Error ist annualisiert und wird anhand von Daten aus dem Beobachtungszeitraum über die vorausgegangenen 36 Monate berechnet. Wird ein Fonds noch keine 36 Monate gehandelt, ist der annualisierte Tracking Error seit Auflegung aufgeführt.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Performanceübersicht, Tracking-Differenz und Tracking Error (Fortsetzung)

Die Tabelle und die entsprechenden Fußnoten geben außerdem die vorrangigen Einflussfaktoren an, die sich auf die Tracking-Differenz vor Abzug des TER auswirken und bei denen der realisierte Tracking Error größer ist als der erwartete Tracking Error. Zu den Hauptfaktoren, die die Tracking-Differenz beeinflussen, gehören die Wertpapierleihe und Anlagetechniken. Zu den primären Faktoren, die sich auf die Tracking-Differenz auswirken, gehören das Liquiditätsmanagement, Handelskosten durch Neugewichtungen, die Währungsabsicherung, gehaltene Futures und Stichprobenverfahren. Eine Nettoertragsdifferenz und Steuern können ebenfalls die Tracking-Differenz und den Tracking Error beeinflussen, da der Fonds auf Anlageerträge Quellensteuern leisten muss. Höhe und Ausmaß der Tracking-Differenz bzw. des Tracking Error aufgrund von Quellensteuern richten sich nach verschiedenen Faktoren, zum Beispiel nach Rückforderungen im Namen des Fonds an verschiedene Steuerbehörden, vom Fonds im Rahmen eines Steuerabkommens in Anspruch genommenen steuerlichen Vorteilen oder vom Fonds getätigten Wertpapierleihgeschäften. Diese Auswirkungen können jedoch in Abhängigkeit der vorliegenden Umstände wohlgemerkt positiv oder negativ sein.

Index-nachbildende Fonds

Name des Fonds	Fondsrendite %	Benchmarkindex	TER %	Tracking-Differenz vor TER %	Primäre Faktoren, die sich auf die Tracking-Differenz auswirken				Sonstige Faktoren für die Tracking-Differenz und den Tracking Error	
					Nettoertragsdifferenz und Steuern ⁽¹⁾	Wertpapierleihe	Anlage-technik ⁽²⁾	Erwarteter Tracking Error %		Realisierter Tracking Error %
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund - Anteilklasse Institutional Distributing	24,93	23,95	0,22	1,20	-	-	-	Bis zu 0,60	1,57	a,b
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1 - EUR - Anteilklasse Institutional Accumulating	6,73	6,82	0,05	(0,04)	-	-	-	Bis zu 0,30	0,05	
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ³ - EUR - Anteilklasse Institutional Accumulating	(2,56)	(2,46)	0,10	-	-	-	-	Bis zu 0,20	0,07	

¹ Bestehend aus der Differenz der Quellensteuersätze, Steuerrückforderungen und Differenzen bei der zeitlichen Verteilung der Erträge zwischen dem Fonds und dem Benchmarkindex.

² Bestehend aus dem Liquiditätsmanagement, Handelskosten durch Neugewichtungen, der Währungsabsicherung, gehaltenen Futures und Stichprobenverfahren.

³ Der Fonds wurde im Geschäftsjahr vollständig zurückgenommen. Die Renditen sind vom Beginn des Geschäftsjahres bis zum letzten vollständigen Performance-Zeitraum des Fonds ausgewiesen.

^a Die Tracking-Differenz ergab sich durch Handelsmerkmale, die sich auf die Fondsrendite im Verhältnis zum Index auswirkten, da sich die meisten der in diesem Portfolio gehaltenen zugrunde liegenden Fonds durch ESG-Merkmale auszeichnen, während es sich bei der zum Vergleich der Wertentwicklung herangezogenen Benchmark um eine Standardbenchmark ohne ESG-Merkmale (MSCI All Country World NET TR Index (EUR)) handelt.

^b Der realisierte Tracking Error von 1,57 % war auch ein Ergebnis der Bewertungsunterschiede zwischen der Benchmark und dem Fonds. Es wird auch darauf hingewiesen, dass die Tracking-Historie zu kurz ist, um eine statistisch signifikante Zahl für den Tracking Error zu generieren, da der Fonds noch nicht für länger als 3 Jahre gehandelt wurde.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Performanceübersicht, Tracking-Differenz und Tracking Error (Fortsetzung)

Aktive Fonds

Name des Fonds	Fondsrendite %	Performance-Indikator %
BlackRock UK Credit Screened Fund ¹ - Anteilklasse Flexible Accumulating	2,56	2,46
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund - Klasse D Accumulating	6,59	3,64
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹ - EUR - Anteilklasse Flexible Accumulating	1,37	1,88
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund - Anteilklasse Institutional 1 Distributing	6,27	3,64
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund - Klasse D Accumulating	8,09	8,15
BlackRock Global Equity Selection Fund - Klasse D Accumulating	21,06	20,25
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund - Klasse D Accumulating	10,47	k. A.
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund - Klasse D Accumulating	7,93	k. A.
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹ - Anteilklasse Flexible Accumulating	(4,55)	(3,20)
FR Multi-Asset Fund - Institutional EUR Accumulating	15,09	11,73
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ² - Klasse D EUR Accumulating	4,92	k. A.

¹Der Fonds wurde im Geschäftsjahr vollständig zurückgenommen. Die Renditen werden vom Beginn des Geschäftsjahres bis zum Datum der vollständigen Rücknahme des Fonds ausgewiesen.

²Der Fonds nahm den Handel im Geschäftsjahr auf. Die Renditen werden vom Auflegungsdatum bis zum Ende des Geschäftsjahres angegeben.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Indikator für die künftige Performance und sollte bei der Auswahl eines Produktes nicht der alleinige Entscheidungsfaktor sein. Sämtliche Finanzanlagen gehen mit einem Risiko einher. Deshalb werden der Wert Ihrer Anlage und die daraus resultierenden Erträge schwanken, und Ihr ursprünglicher Anlagebetrag kann nicht garantiert werden. Die Performance-Zahlen berücksichtigen keine Abgaben und Gebühren, die zum Zeitpunkt der Zeichnung oder Rücknahme von Anteilen erhoben werden können. Die Höhe und jeweilige Grundlage der Besteuerung können sich mitunter ändern. Zeichnungen dürfen nur auf der Grundlage des aktuellen Prospekts erfolgen, wobei der letzte Jahresbericht und geprüfte Jahresabschluss, der letzte Halbjahresbericht und ungeprüfte Halbjahresabschluss, aber auch die PRIIP-KIDs, ein wesentlicher Bestandteil desselben sind. Exemplare davon sind bei Investor Services, der Transferstelle, der Verwaltungsgesellschaft oder einem der Vertreter oder der Vertriebsgesellschaft erhältlich.

Globaler Wirtschaftsüberblick

Die globalen Aktien, die durch den MSCI All Country World Index repräsentiert werden, verzeichneten in den zwölf Monaten bis zum 31. März 2024 (in USD) eine Rendite von 23,22 %. Aktienwerte legten deutlich zu, da die Inflation (d. h. die Steigerungsrate der Preise für Waren und Dienstleistungen) niedriger ausfiel und sich die Anleger optimistisch zeigten, dass die größten Zentralbanken der Welt ihren geldpolitischen Kurs ändern könnten. Doch zunehmende geopolitische Spannungen in der zweiten Hälfte des zwölfmonatigen Berichtszeitraums, darunter der Krieg im Nahen Osten und Angriffe auf die Frachtrouten im Roten Meer, könnten für verstärkte Störungen der Weltwirtschaft sprechen.

In den USA zeigte die Wirtschaft während des gesamten Berichtszeitraums ein robustes Bild und verzeichnete ein stärkeres Wachstum als andere Industrieländer, was sowohl an den steigenden Verbraucher- als auch den zunehmenden Staatsausgaben lag. Die Verbraucherausgaben in den USA wurden durch Lohnzuwächse und hohe Vermögenspreise gestützt, und das Vertrauen der Verbraucher zeigte vor dem Hintergrund einer sinkenden Inflation Anzeichen einer Erholung. Der US-Arbeitsmarkt blieb weiterhin stark, und die Arbeitslosigkeit hielt sich trotz eines Anstiegs gegen Ende des Zwölfmonatszeitraums unter 4 %. Die japanische Wirtschaft schrumpfte im dritten Quartal 2023 stark, wobei der Rückgang des privaten Verbrauchs und der Investitionsausgaben ausschlaggebend war. Im vierten Quartal wurde dann wieder ein bescheidenes Wachstum verzeichnet. Die Wirtschaft des Vereinigten Königreichs stagnierte und schrumpfte in der letzten Hälfte des Jahres 2023 leicht, da sich die Exporte abschwächten und die Verbraucherausgaben nachließen. In der Eurozone stagnierte das Wachstum im dritten Quartal. Die Wirtschaft der Region wurde durch die hohen Zinssätze weiterhin belasteten, obwohl die Wirtschaft in der Eurozone im vierten Quartal zu einem leichten Wachstum zurückkehrte.

Die meisten Schwellenländer setzten ihr Wachstum fort, obwohl das hohe Zinsumfeld erhebliche wirtschaftliche Herausforderungen darstellte. Die chinesische Wirtschaft wuchs angesichts erheblicher staatlicher Anreize weiter, wengleich sinkende Verbraucherpreise die Angst vor einer Deflation (d. h. fallenden Preisen für Waren und Dienstleistungen) schürten. Die indische Wirtschaft wuchs, unterstützt durch die Stärke des verarbeitenden Gewerbes und die wieder anziehenden Exporte, in einem robusten Tempo. Das Wirtschaftswachstum in Brasilien verlief in der zweiten Hälfte des Jahres 2023 aufgrund der Schwäche des Agrarsektors seitwärts.

Die größten Zentralbanken der Welt gingen im zwölfmonatigen Berichtszeitraum von einer straffen zu einer neutralen Geldpolitik über. Die US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“) hob die Zinssätze dreimal an, deutete aber auch an, dass weitere Zinserhöhungen unwahrscheinlich seien. Außerdem baute die Fed auch die aufgelaufenen Anleihepositionen in ihrer Bilanz weiter ab. Die Bank of England (die „BoE“) hob die Zinssätze während des zwölfmonatigen Berichtszeitraums vier Mal an, doch beließ sie die Zinssätze auf ihrer Sitzung im August unverändert. Auch die Europäische Zentralbank (die „EZB“) lehnte auf ihren letzten vier Sitzungen des Berichtszeitraums Zinserhöhungen ab, nachdem sie sie zuvor fünf Mal erhöht hatte. Eine bemerkenswerte Veränderung war, dass die Bank of Japan zum ersten Mal seit 2007 die Zinsen anhob.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Globaler Wirtschaftsüberblick (Fortsetzung)

Die Wertentwicklung globaler Aktienwerte war im zwölfmonatigen Berichtszeitraum sehr positiv, da die anhaltend starke Weltwirtschaft trotz der sich rasch verändernden Wirtschafts- und Kreditbedingungen die Sorge vor einer möglichen Rezession zerstreute. Die rückläufige Inflation und das langsamere Zinserhöhungstempo der Fed schürte Hoffnungen, dass der aktuelle geldpolitische Straffungszyklus beendet ist. Weltweit sahen sich Anleihen und Aktien, die die Merkmale von Unternehmen in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) berücksichtigen, mit regulatorischen Bedenken und einer veränderten Anlegerstimmung konfrontiert. ESG-Fonds verzeichneten in den ersten drei Quartalen 2023 insgesamt positive, wenn auch rückläufige Zuflüsse. Im vierten Quartal folgten dann Nettoabflüsse, die in erster Linie auf Abflüsse aus den USA zurückzuführen waren.

Die Renditen (die sich umgekehrt zu den Kursen bewegen) stiegen bei der 10-jährigen US-Staatsanleihe, ein Referenzzinssatz für den globalen Anleihenmarkt. Die Renditekurve, die die Differenz zwischen den Renditen verschiedener Laufzeiten misst, blieb umgekehrt, so dass die Renditen auf kürzere Laufzeiten höher waren als die von Papieren mit längeren Laufzeiten, was ein Zeichen dafür ist, dass die Anleger über eine Verlangsamung des Wirtschaftswachstums besorgt waren. Die Herabstufung der US-Staatsanleihen durch eine große Ratingagentur machte die steigenden Schuldendienstkosten deutlich. Im Vereinigten Königreich gaben die Kurse von Staatsanleihen aufgrund von Bedenken über die Entwicklung der britischen Wirtschaft insgesamt leicht nach. Demgegenüber legten europäische Staatsanleihen zu, da die veränderte Haltung der EZB in der zweiten Jahreshälfte eine Rally einleitete. Die japanische Regierung adjustierte ihre Renditeobergrenze für 10-jährige Staatsanleihen, was zu einem erheblichen Anstieg der Renditen für diese Papiere führte, während umfangreiche Käufe durch die Bank of Japan in der Folge für schwankende Kurse sorgten.

Unternehmensanleihen verbuchten weltweit starke Gewinne, da die Anleger solche Papiere im Hinblick auf das nachlassende Inflationstempo neu bewerteten. Die höheren Anleihenrenditen zogen Anleger an, und die anhaltende Widerstandsfähigkeit der Weltwirtschaft milderte die Sorgen um die Kreditwürdigkeit, insbesondere mit Blick auf Hochzinsanleihen.

Die Aktien der Schwellenländer verbuchten ebenfalls Kursanstiege und profitierten von dem relativ stabilen globalen Wirtschaftsumfeld und der Verschnaufpause der strafferen Geldpolitik. Als die Sorgen über eine mögliche Rezession abnahmen, investierten einige Anleger erneut in Schwellenländeraktien, was zu einem Anstieg der Kurse führte. Die Kurse von Schwellenländeranleihen verzeichneten insgesamt positive Renditen, da die Anleger auf eine weniger restriktive Geldpolitik in den Industrieländern reagierten, die das globale Wachstum antreiben.

Im Anschluss an die Turbulenzen des Jahres 2022 stabilisierten sich die Rohstoffmärkte, obwohl die zunehmenden geopolitischen Spannungen die Aussicht auf weitere Marktstörungen erhöhten. Die Rohölpreise der Sorte Brent stiegen leicht an, da die instabile Lage im Nahen Osten Grund zur Sorge gab, auch wenn die weltweite Ölproduktion, insbesondere in den USA und Kanada, zunahm. Die Erdgaspreise gingen zurück, weil die Produktion angekurbelt wurde und zusätzliche Flüssiggasanlagen in Betrieb genommen wurden. Die Goldpreise zogen angesichts der erhöhten Inflation, des starken US-Dollar und dem Ende des Zinserhöhungszyklus der Fed kräftig an.

An den Devisenmärkten war die Performance des US-Dollar gegenüber den meisten anderen globalen Währungen stärker. Der US-Dollar legte gegenüber dem japanischen Yen deutlich zu, während er gegenüber dem chinesischen Yuan und dem Euro moderater stieg. Gegenüber dem Pfund Sterling gab der US-Dollar allerdings leicht nach.

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio

BlackRock UK Credit Screened Fund

BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund

BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund

Im April 2023 ging die Volatilität an den Anleihenmärkten gegenüber dem Vormonat zurück, da die Angst vor der Bankenkrise nachließ. Die negative Stimmung an den Anleihenmärkten im Mai 2023 war eine Folge der Unsicherheit im Zusammenhang mit den Verhandlungen über die US-Schuldenobergrenze. Nach einer gemischten Performance im Juni 2023 hob die Fed im Juli 2023 die Leitzinsen an, bevor sie sich auf ihrer Sitzung im September für eine Pause bei den Zinserhöhungen aussprach. Ebenso stoppte die EZB ihre Zinserhöhungen auf ihrer Sitzung im September 2023. Das Jahr 2023 endete ausgesprochen positiv, nachdem maßgebliche Zentralbanken offensichtlich das Ende ihres Straffungszyklus erreicht hatten, was dazu führte, dass die Anleihenrenditen (die sich umgekehrt zu den Anleihenkursen bewegen) in den Industrieländern sanken. Das neue Marktnarrativ lautete nunmehr, dass die Zinsen noch länger auf höherem Niveau verharren sollten, bis die Inflationsziele erreicht sind. Im Januar 2023 war die Marktstimmung an den globalen Anleihenmärkten leicht negativ, während sie im Februar 2024 gemischt war: Die Renditen auf Staatsanleihen aus Industrieländern stiegen, doch verengten sich die Kreditspreads (der Renditeunterschied zwischen Staats- und Unternehmensanleihen mit ähnlichen Laufzeiten) in dem recht risikofreudigen Umfeld. Der März war im Großen und Ganzen ein positiver Monat für festverzinsliche Anlageklassen, wobei sich die Spreads leicht verengten und die Renditen geringfügig zurückgingen.

BlackRock UK Credit Screened Fund

Im Zeitraum vom 1. April 2023 bis zum 6. Dezember 2023 betrug die Performance des Fonds 2,56 %. Die aktive Rendite lag bei 0,10 % und damit über seinem Performanceindikator, der 2,46 % auswies (die aktive Rendite entspricht der Differenz zwischen der Fondsrendite und der Rendite des Performanceindikators).

In einem Schreiben vom 28. September 2023 wurden die Anteilinhaber darauf hingewiesen, dass der Fonds aufgrund der erwarteten vollständigen Rücknahme der Anteile im Jahresverlauf mit Wirkung zum 6. Dezember 2023 geschlossen werden sollte. Das Investmentteam begann am 30. November 2023 mit der Abwicklung des Portfolios, um bis zur endgültigen Schließung des Fonds die Liquiditätsanforderungen zu erfüllen. Im Anschluss folgt ein Bericht über die Wertentwicklung und die abschließende Positionierung für den Berichtszeitraum zum 30. November 2023.

Im Verlauf des Berichtszeitraums schnitt der Fonds besser ab als sein Performanceindikator. Der Fonds war defensiv aufgestellt, mit Untergewichtungen (Screens) bestimmter Unternehmen sowie von gewissen Pharmatiteln aus dem Basiskonsumgütersektor. Darüber hinaus hat der Fonds auch ausgewählte Emissionen aus dem Bereich der Festnetzanbieter sowie Eisenbahngesellschaften ausgesondert.

Im Bereich der Finanzwerte war der Fonds in bestimmten immobilienbezogenen Finanzemittenten, bei Banktiteln und REITs defensiv positioniert.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio (Fortsetzung)

BlackRock UK Credit Screened Fund (Fortsetzung)

Die folgenden Positionen lieferten im Berichtszeitraum die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite im Vergleich zu dem entsprechenden Performanceindikator:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Sektor	Auswirkung auf die Fondsrendite	Sektor	Auswirkung auf die Fondsrendite
Versicherungen [#]	0,11 %	Technologie [∅]	(0,03 %)
Banken [∅]	0,04 %	Investitionsgüter [∅]	(0,01 %)
Erdgas [#]	0,03 %		
Energie [#]	0,02 %		
Kommunikation [∅]	0,02 %		

[#] Übergewichtete Position – stärker gewichtet als im Performanceindikator.

[∅] Untergewichtete Position – geringer gewichtet als im Performanceindikator.

BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund

Im Geschäftsjahr betrug die Fondsrendite 6,59 % und lag damit über seinem Performanceindikator, der 3,64 % auswies (die aktive Rendite entspricht der Differenz zwischen der Fondsrendite und der Rendite des Performanceindikators).

Der Fonds blieb weiterhin defensiv aufgestellt und fuhr während des Berichtszeitraums seine Allokation in Hochzinsanleihen zurück. Zum 31. März 2024 hielt der Fonds 71,3 % des Marktwerts des Gesamtportfolios in Investment-Grade-Unternehmensanleihen, verglichen mit 66,2 % zu Beginn des Berichtszeitraums. Davon entfielen 28,5 % auf Hochzinsanleihen, verglichen mit 34 % zu Beginn des Berichtszeitraums.

Die folgenden Positionen lieferten im Verlauf des Geschäftsjahres die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Sektor	Auswirkung auf die Fondsrendite	Sektor	Auswirkung auf die Fondsrendite
Banken [#]	1,86 %		
Zyklische Konsumgüter [#]	0,88 %		
Basiskonsumgüter [#]	0,84 %		
Investitionsgüter [#]	0,55 %		
Kommunikation [#]	0,53 %		

[#] Übergewichtete Position – stärker gewichtet als im Performanceindikator.

[∅] Untergewichtete Position – geringer gewichtet als im Performanceindikator.

Die Auswahl von Unternehmensanleihen generierte Mehrwert im Berichtszeitraum.

Unter den Industriewerten erzielten die Übergewichtung ausgewählter Automobilunternehmen innerhalb des Segments der zyklischen Konsumgüter sowie ausgewählte pharmazeutischer Namen innerhalb der Basiskonsumgüter starke Erträge. Bei Finanzinstituten erzielten übergewichtete Allokationen zu ausgewählten Banknamen eine überdurchschnittliche Performance. Bei den Versorgern trug die Übergewichtung ausgewählter Strom- und Gasversorger positiv zur Wertentwicklung bei.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 31. März 2024 und 31. März 2023 angegeben:

31. März 2024		31. März 2023	
Sektor	Brutto engagement	Sektor	Brutto engagement
Banken	26,93 %	Banken	21,62 %
Basiskonsumgüter	12,85 %	Basiskonsumgüter	16,57 %
Zyklische Konsumgüter	11,68 %	Zyklische Konsumgüter	11,66 %
Investitionsgüter	9,22 %	Kommunikation	9,32 %
Kommunikation	7,64 %	Investitionsgüter	7,31 %

BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund

Im Zeitraum vom 1. April 2023 bis zum 20. März 2024 betrug die Fondsrendite 1,37 % und lag damit unter seinem Performanceindikator, der 1,88 % auswies (die aktive Rendite entspricht der Differenz zwischen der Fondsrendite und der Rendite des Performanceindikators).

In einem Schreiben vom 25. Januar 2024 wurden die Anteilinhaber darauf hingewiesen, dass der Fonds aufgrund der erwarteten vollständige Rücknahme der Anteile im Jahresverlauf mit Wirkung zum 20. März 2024 geschlossen werden sollte. Das Investmentteam begann am 29. Februar 2024 mit der Abwicklung des Portfolios, um bis zur endgültigen Schließung des Fonds die Liquiditätsanforderungen zu erfüllen. Im Anschluss folgt ein Bericht über die Wertentwicklung und die abschließende Positionierung für den Berichtszeitraum zum 29. Februar 2024.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio (Fortsetzung)

BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund (Fortsetzung)

Die folgenden Positionen lieferten im Berichtszeitraum die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite im Vergleich zu dem entsprechenden Performanceindikator:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Land	Auswirkung auf die Fondsrendite	Land	Auswirkung auf die Fondsrendite
Südkorea #	0,24 %	Japan #	(0,22 %)
Italien #	0,15 %	Vereinigte Staaten #	(0,10 %)
Frankreich #	0,11 %	Australien #	(0,08 %)
Österreich #	0,09 %	Vereinigtes Königreich #	(0,07 %)
Schweiz #	0,07 %	Kanada #	(0,01 %)

Übergewichtete Position – stärker gewichtet als im Performanceindikator.

∅ Untergewichtete Position – geringer gewichtet als im Performanceindikator.

Während des Berichtszeitraums behielt der Fonds seine übergewichteten Allokationen zu Großbritannien, Japan, Südkorea und den USA bei. Allokationen zu Südkorea, Italien, Frankreich und Österreich generierten Alpha, während die Positionierungen in Japan, den USA, Australien und dem Vereinigten Königreich die Performance schmälerte.

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die wesentlichen aktiven Positionen, in denen der Fonds zum 29. Februar 2024 und zum 31. März 2023 übergewichtet (mit einem höheren Exposure als der Performanceindikator) und untergewichtet (mit einem niedrigeren Exposure als der Performanceindikator) war:

Größte übergewichtete Positionen			
29. Februar 2024		31. März 2023	
Land	Gewichtung	Land	Gewichtung
Australien	2,74 %	Deutschland	3,57 %
Südkorea	2,10 %	Niederlande	1,98 %
Deutschland	2,03 %	Österreich	1,55 %

Größte untergewichtete Positionen			
29. Februar 2024		31. März 2023	
Land	Gewichtung	Land	Gewichtung
Italien	(3,44 %)	Italien	(3,45 %)
Frankreich	(3,42 %)	Spanien	(1,07 %)
Spanien	(2,95 %)	Portugal	(0,62 %)

Wenn der Fonds in einem Sektor untergewichtet war, (i) wirkt sich die Rendite aus diesem Sektor gegenläufig auf die aktive Rendite des Fonds aus. Dies kann (ii) dazu führen, dass ein Sektor zwar unter den Positivbeiträgen/Negativbeiträgen, jedoch nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte des Fonds aufgeführt wird.

BlackRock Diversifying Fixed Income Fund

Im Geschäftsjahr bis zum 31. März 2024 betrug die Fondsrendite 6,27 %. Die aktive Rendite lag bei 2,64 % und damit über seinem Performanceindikator, der 3,64 % auswies (die aktive Rendite entspricht der Differenz zwischen der Fondsrendite und der Rendite des Performanceindikators).

Ab Ende März 2024 scheint sich eine mehr stabile globale Finanzlandschaft mit Anzeichen von Wirtschaftswachstum fortzusetzen. Die großen Zentralbanken haben damit begonnen, ihre Zinserhöhungen aufgrund des nachlassenden Inflationsdrucks zu stoppen. Ihr Ziel ist es, die Inflation innerhalb eines bestimmten Zielbereichs zu halten – dieser liegt für gewöhnlich um die 2 % –, auch wenn Zentralbanken bereit sind, vorübergehend von diesem Ziel abzuweichen.

Unterdessen bleibt die grundlegende Situation in den Schwellenländern wie auch weltweit unterstützend und ist, wenn überhaupt, zunehmend positiv: Das Wachstum in den Schwellenländern ist robust; die Inflationsüberraschungen in den Schwellenländern sind günstig (wenn dies auch für Industrieländer nicht der Fall ist); der Lockerungszyklus in den Schwellenländern beschleunigt sich; die US-Notenbank hat eine frühzeitige Lockerung verschoben, aber auch Hinweise darauf gegeben, dass sie eine Lockerung nicht durchweg ablehnt; das globale verarbeitende Gewerbe scheint sich zu stabilisieren; Europa scheint einen Tiefpunkt erreicht zu haben; und die Wahrscheinlichkeit, dass China Konjunkturmaßnahmen ergreifen wird, hat zugenommen.

Aufgrund des günstigen Wachstums, der Stabilisierung der Inflation und der sich verengenden Spreads war die Wertentwicklung des Fonds positiv.

Diese Umstände haben dazu geführt, dass der Fonds für das laufende Jahr eine Rendite von 6,27 % verbucht hat, mit zum einen bemerkenswerten Wertbeiträgen seitens seiner Vermögenswerte mit der besten Performance – es seien hier vor allem Hochzinsanleihen erwähnt – und zum anderen ohne erkennbare Verluste innerhalb des Portfolios.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio (Fortsetzung)

BlackRock Diversifying Fixed Income Fund (Fortsetzung)

Die folgenden Positionen lieferten im Verlauf des Geschäftsjahres die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Positionen	Auswirkung auf die Fondsrendite	Positionen	Auswirkung auf die Fondsrendite
BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund EUR Hedge	1,92 %	iShares \$ TIPS UCITS ETF EUR	
iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF	1,19 %	HGD A	(0,05 %)
iShares ESG Screened Global Corporate Bond Index Fund (IE)	1,16 %		
iShares J.P. Morgan \$ Emerging Market Bond EUR Hedged UCITS ETF (Dist)	0,92 %		
iShares Euro Government Bond Index Fund (IE)	0,71 %		

Wir haben eine Aktienmarkttrally beobachtet, die den Markt wieder auf das Niveau zur Zeit der Pandemie von 2022 gebracht hat. Dies wurde durch ein allgemeines Wachstum der Erträge in Verbindung mit robusten Gewinnspannen und einer umsichtigen Nutzung von Schulden vorangetrieben, was sich positiv auf Unternehmens-, Hochzins- und Schwellenländeranleihen auswirkte.

Die EZB hat zwar die Absicht geäußert, die Zinssätze zu senken, doch bleibt der Zeitpunkt für den Einsatz einer solchen Strategie ungewiss.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 31. März 2024 und 31. März 2023 angegeben:

31. März 2024		31. März 2023	
Anlageklasse	Brutto engagement	Anlageklasse	Brutto engagement
Hoch rentierliche Unternehmensanleihen	31,27 %	Hoch rentierliche Unternehmensanleihen	31,77 %
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität (Investment Grade)	30,88 %	Unternehmensanleihen mit Anlagequalität (Investment Grade)	30,88 %
Auf harte Währungen lautende Schwellenländeranleihen	22,21 %	Auf harte Währungen lautende Schwellenländeranleihen	21,83 %
Staatsanleihen	14,90 %	Staatsanleihen	15,23 %
Zahlungsmittel und Sonstige	0,75 %	Zahlungsmittel und Sonstige	0,29 %

Ende März 2024 gab es keine wesentlichen Änderungen in der Vermögensallokation verglichen mit der Aufteilung gegen Ende März 2023.

BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund

Im Geschäftsjahr bis zum 31. März 2024 betrug die Performance des Fonds 8,09 %. Die aktive Rendite lag bei (0,06) % und damit unter seinem Performanceindikator, der 8,15 % auswies (die aktive Rendite entspricht der Differenz zwischen der Fondsrendite und der Rendite des Performanceindikators).

Die Anlagestrategie des Fonds verwendet quantitative (mathematische oder statistische) Modelle, um bei der Titelauswahl einen systematischen (regelbasierten) Ansatz zu verfolgen.

Die Titelauswahl war im Laufe des Jahres die vorrangige Antriebskraft der Wertentwicklung, gefolgt von Risikoengagements. Branchenengagements wirkten sich hingegen negativ aus. Makroökonomische themenbezogene Erkenntnisse mit Schwerpunkt auf der Länder- und Branchenauswahl leisteten die größten Beiträge zur Wertentwicklung. Traditionellere fundamental orientierte Einblicke trugen ebenfalls zur Performance bei, vor allen Dingen Value-Insights, die darauf ausgerichtet sind, attraktiv bewertete Unternehmen zu identifizieren. Während Erkenntnisse auf Basis der Ansichten der Sell-Side-Analysten zu Gewinnen führten, wurden diejenigen, die die Nutzung mobiler Apps und die Aktienkursentwicklung beobachten, im Berichtszeitraum auf dem falschen Fuß erwischt. Eine relativ übergewichtete Position in IT trug wesentlich zur Wertentwicklung bei. Eine untergewichtete Position in Finanzwerten und eine Übergewichtung von Nicht-Basiskonsumgütern machten die Gewinne allerdings wieder wett.

Die folgenden Positionen lieferten im Geschäftsjahr die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite im Vergleich zu dem entsprechenden Performanceindikator:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Sektor	Auswirkung auf die Fondsrendite	Sektor	Auswirkung auf die Fondsrendite
Informationstechnologie #	1,97 %	Finanzen ∅	(0,90 %)
Industrie ∅	0,73 %	Nicht-Basiskonsumgüter #	(0,80 %)
Gesundheit #	0,49 %	Basiskonsumgüter #	(0,41 %)
Energie #	0,49 %	Werkstoffe #	(0,28 %)
Immobilien ∅	0,27 %	Kommunikationsdienstleistungen #	(0,02 %)

Übergewichtete Position – stärker gewichtet als im Performanceindikator.

∅ Untergewichtete Position – geringer gewichtet als im Performanceindikator.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio (Fortsetzung)

BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die wesentlichen aktiven Positionen, in denen der Fonds zum 31. März 2024 und zum 31. März 2023 übergewichtet (mit einem höheren Exposure als der Performanceindikator) und untergewichtet (mit einem niedrigeren Exposure als der Performanceindikator) war:

Größte übergewichtete Positionen			
31. März 2024		31. März 2023	
Land	Gewichtung	Land	Gewichtung
Taiwan	2,32 %	Taiwan	1,96 %
Brasilien	2,30 %	Südafrika	1,53 %
China	1,29 %	China	1,24 %

Größte untergewichtete Positionen			
31. März 2024		31. März 2023	
Land	Gewichtung	Land	Gewichtung
Mexiko	(1,85 %)	Korea	(1,90 %)
Korea	(1,48 %)	Indien	(1,56 %)
Malaysia	(1,39 %)	Malaysia	(0,62 %)

Wenn der Fonds in einem Sektor untergewichtet war, (i) wirkt sich die Rendite aus diesem Sektor gegenläufig auf die aktive Rendite des Fonds aus. Dies kann (ii) dazu führen, dass ein Sektor zwar unter den Positivbeiträgen/Negativbeiträgen, jedoch nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte des Fonds aufgeführt wird.

BlackRock Global Equity Selection Fund

BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund

BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund

Die beiden mittleren Quartale des Jahres 2023 waren durch für eine längere Zeit höhere Zinssätze gekennzeichnet. Die Anleihenrenditen stiegen im Jahresverlauf stark an und erreichten zu Beginn des vierten Quartals den seit einem Jahrzehnt höchsten Stand, wofür die Sorgen über die Inflation und die Straffung der Geldpolitik ausschlaggebend waren. Die Prognosen besagten, dass die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere und Aktien in diesem Umfeld unter Druck geraten würden, doch erwiesen sie sich als widerstandsfähiger als ursprünglich erwartet. Tatsächlich zeichneten sich die letzten Monate des Jahres durch eine breite Markterholung aus: Der Rückgang der Inflation in den USA und anderen Regionen wurde durch Daten belegt, was zu der Hoffnung führte, dass die Zinssätze ihren Höhepunkt erreicht hatten, und es Aktienwerten ermöglichte, im Laufe des Jahres starke positive Renditen einzufahren (angetrieben von Tech Caps und Mega Caps, während China bei der Underperformance an der Spitze lag). Festverzinsliche Wertpapiere schlossen ebenfalls im positiven Bereich. 2024 hat nach einem Jahr der wirtschaftlichen Unsicherheit ebenfalls stark begonnen, und während sich Aktien weiterhin gut entwickelten und der S&P 500 auf neue Allzeithochs kletterte, schnitten Staatsanleihen nicht so gut ab, da die Zinssenkungen im Jahr 2024 nicht im vollen Umfang umgesetzt worden sind. Darüber hinaus ist die geopolitische Lage nach wie vor unsicher, und die „Krise im Roten Meer“ hat Auswirkungen auf die Handelsschifffahrt.

BlackRock Global Equity Selection Fund

Im Geschäftsjahr bis zum 31. März 2024 betrug die Fondsrendite 21,06 %. Die aktive Rendite lag bei 0,81 % und damit über seinem Performanceindikator, der 20,25 % auswies (die aktive Rendite entspricht der Differenz zwischen der Fondsrendite und der Rendite des Performanceindikators).

Die folgenden Positionen lieferten im Verlauf des Geschäftsjahres die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Vermögenswert	Auswirkung auf die Fondsrendite	Vermögenswert	Auswirkung auf die Fondsrendite
iShares MSCI USA ESG Enhanced	3,57 %	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Fund	(0,27 %)
BlackRock Global Funds - Continental European Flex Fund	2,49 %	BlackRock Global Funds - World Mining Fund	(0,04 %)
BlackRock Sustainable Advantage US EQ Fund	2,18 %		
BlackRock Global Funds - World Technology Fund	2,05 %		
BlackRock Global Unconstrained Equity Fund	1,93 %		

Die Allokation des Fonds zu US-amerikanischen Aktienwerten trug im Geschäftsjahr am meisten zur Performance bei. An zweiter Stelle lag das Engagement des Fonds in europäischen Aktien und im Technologiesektor. Nur zwei Positionen beeinträchtigten die Performance über diesen Berichtszeitraum. Das Engagement des Fonds in chinesischen A-Aktien hatte die stärksten negativen Auswirkungen, gefolgt von der Allokation zu Bergbauunternehmen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio (Fortsetzung)

BlackRock Global Equity Selection Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 31. März 2024 und 31. März 2023 angegeben:

31. März 2024		31. März 2023	
Vermögenswert	Bruttoengagement	Vermögenswert	Bruttoengagement
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	14,10 %	BGF Continental European Flexible Fund	11,60 %
BGF Continental European Flexible Fund	11,30 %	BlackRock Advantage Europe Equity Fund	10,00 %
BlackRock Advantage Europe Equity Fund	10,30 %	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF	9,90 %
iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF	10,00 %	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	9,60 %
BGF European Special Situations Fund	8,90 %	BGF European Special Situations Fund	9,20 %

BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund

Im Geschäftsjahr bis zum 31. März 2024 betrug die Rendite des Fonds 10,47 %.

Die folgenden Positionen lieferten im Verlauf des Geschäftsjahres die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Strategie	Auswirkung auf die Fondsrendite	Strategie	Auswirkung auf die Fondsrendite
BlackRock Advantage European Equity Fund	1,41 %	Derivate (Fremdwährungsabsicherung) und Zahlungsmitteläquivalente	(0,48 %)
BlackRock Global Funds - Continental European Flex Fund	1,37 %	BlackRock Global Funds Systematic China A-Share Fund	(0,27 %)
BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund	1,17 %	iShares \$ TIPS UCITS ETF	(0,17 %)
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	1,08 %	iShares \$ Treasury Bond 20+ Y UCTS ETF	(0,09 %)
BlackRock Global Unconstrained Equity Fund	0,80 %	iShares \$ Treasury Bond 7-10 Y UCTS ETF	(0,03 %)

Aktien aus Industrieländern leisteten den größten Beitrag zur Wertentwicklung, insbesondere europäische Titel (angesichts der strukturellen lokalen Ausrichtung des Fonds) und US-Aktien. Alle anderen Anlageklassen wie Schwellenländeraktien und festverzinsliche Papiere trugen ebenfalls zur Performance bei, wenn auch weniger stark. Am stärksten wurde die Performance im Berichtszeitraum durch Devisenabsicherungskosten beeinträchtigt, gefolgt von chinesischen Aktien und dem Engagement bei einigen US-Staatsanleihen (auch durch den Zeitpunkt beeinflusst).

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 31. März 2023 und 31. März 2024 angegeben:

31. März 2024		31. März 2023	
Strategie	Bruttoengagement	Strategie	Bruttoengagement
BlackRock Advantage European Equity Fund	8,21 %	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF EUR Hedged	6,89 %
iShares \$ Corp Bond ESG ETF EUR Hedged	6,89 %	iShares EUR Ultrashort Bond UCITS ETF	6,85 %
BlackRock Strategic Funds - Sustainable Euro Bond Fund	6,79 %	BlackRock Global Funds - Continental European Flex Fund	6,77 %
BlackRock Global Funds - Continental European Flex Fund	6,56 %	BlackRock Strategic Funds - Sustainable Euro Bond Fund	6,62 %
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	6,00 %	BlackRock Advantage European Equity Fund	6,32 %

BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund

Im Geschäftsjahr bis zum 31. März 2024 betrug die Rendite des Fonds 7,93 %.

Die folgenden Positionen lieferten im Verlauf des Geschäftsjahres die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Strategie	Auswirkung auf die Fondsrendite	Strategie	Auswirkung auf die Fondsrendite
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	2,12 %	Derivate (Fremdwährungsabsicherung) und Zahlungsmitteläquivalente	(0,64 %)
BlackRock Global Funds - World Technology Fund	0,84 %	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Fund	(0,27 %)
BlackRock Global Funds - World Financials Fund	0,68 %	iShares \$ TIPS UCITS ETF	(0,16 %)
BlackRock Global Unconstrained Equity Fund	0,49 %	iShares \$ Treasury Bond 20+ Y UCTS ETF	(0,06 %)
BlackRock Tactical Opportunities Fund	0,40 %	BlackRock Global Funds - Global Event Driven Fonds	(0,04 %)

Aktien aus Industrieländern leisteten den größten Beitrag zur Performance, gefolgt von der Allokation zu nicht-staatlichen Anleihen. Alle anderen Anlageklassen wie Schwellenländeraktien, Rohstoffe und Hedgefonds trugen ebenfalls zur Performance bei, wenn auch in geringerem Maße. Am stärksten wurde die Performance im Berichtszeitraum durch Devisenabsicherungskosten beeinträchtigt, gefolgt von chinesischen Aktien und dem Engagement bei einigen US-Staatsanleihen (auch durch den Zeitpunkt beeinflusst).

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio (Fortsetzung)

BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 31. März 2024 und 31. März 2023 angegeben:

31. März 2024		31. März 2023	
Strategie	Bruttoengagement	Strategie	Bruttoengagement
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	10,12 %	BlackRock Strategic Funds - Sustainable Euro Bond Fund	6,84 %
BlackRock Strategic Funds - Sustainable Euro Bond Fund	6,77 %	iShares EUR Ultrashort Bond UCITS ETF	6,43 %
iShares \$ Corporate Bond ESG EUR Hedged	5,95 %	BlackRock Strategic Funds - European Absolute Return Fund	5,97 %
iShares USD Treasury Bond 1- EUR	5,53 %	BlackRock Global Funds - GBL INFL LNKD BD FUND Hedged	4,93 %
iShares USD Treasury Bond 3-7 ETF \$	4,96 %	iShares Global Aggregate Bond Hedged	4,58 %

Der Fonds hat die Gewichtung von US-Aktien über den iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF erhöht, die Allokation zu Aktien mit minimaler Volatilität wurde beendet und die Positionierungen bei liquiden Alternativen wie den BlackRock Strategic Funds - European Absolute Return Fund wurde angesichts des günstigeren Momentums und der attraktiveren Renditen bei festverzinslichen Wertpapieren reduziert.

BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund

Im Zeitraum vom 1. April 2023 bis zum 27. Juni 2023 betrug die Fondsrendite (4,55) %. Die aktive Rendite lag bei (1,35) % und damit unter seinem Performanceindikator, der (3,20) % auswies (die aktive Rendite entspricht der Differenz zwischen der Fondsrendite und der Rendite des Performanceindikators).

In einem Schreiben vom 13. April 2023 wurden die Anteilinhaber darauf hingewiesen, dass der Fonds aufgrund der erwarteten vollständige Rücknahme der Anteile im Jahresverlauf mit Wirkung zum 27. Juni 2023 geschlossen werden sollte. Das Investmentteam begann am 31. Mai 2023 mit der Abwicklung des Portfolios, um bis zur endgültigen Schließung des Fonds die Liquiditätsanforderungen zu erfüllen. Im Anschluss folgt ein Bericht über die Wertentwicklung und die abschließende Positionierung für den Berichtszeitraum zum 31. Mai 2023.

Die Anlagestrategie des Fonds verwendet quantitative (mathematische oder statistische) Modelle, um bei der Titelauswahl einen systematischen (regelbasierten) Ansatz zu verfolgen.

Unsere hausinternen Einblicke beschäftigten sich schwerpunktmäßig mit dem Thema Wohlfahrt innerhalb von ESG und das war der Hauptgrund für die negative Performance. Einige unserer Erkenntnisse in Bezug auf schnelllebige Markttrends haben sich im Berichtszeitraum ebenfalls als falsch herausgestellt. Andererseits trugen unsere Erkenntnisse, die sich auf ökologische Faktoren im ESG-Bereich beziehen, zur Performance bei und machten einige dieser Verluste wett.

Die folgenden Positionen lieferten im Berichtszeitraum die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite im Vergleich zu dem entsprechenden Performanceindikator:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Sektor	Auswirkung auf die Fondsrendite	Sektor	Auswirkung auf die Fondsrendite
Finanzen ^o	0,03 %	Basiskonsumgüter ^o	(0,03) %
Nicht-Basiskonsumgüter [#]	0,02 %	Kommunikationsdienstleistungen ^o	(0,02) %
Gesundheit ^o	0,02 %	Versorger [#]	(0,02) %
Immobilien ^o	0,02 %		
Industrie [#]	0,01 %		

[#] Übergewichtete Position – stärker gewichtet als im Performanceindikator.

^o Untergewichtete Position – geringer gewichtet als im Performanceindikator.

In einem Schreiben vom 13. April 2023 wurden die Anteilinhaber darauf hingewiesen, dass der Fonds aufgrund der erwarteten vollständige Rücknahme der Anteile im Jahresverlauf mit Wirkung zum 27. Juni 2023 geschlossen werden sollte. Das Investmentteam begann am 31. Mai 2023 mit der Abwicklung des Portfolios, um bis zur endgültigen Schließung des Fonds die Liquiditätsanforderungen zu erfüllen. Im Anschluss folgt ein Bericht über die Wertentwicklung und die abschließende Positionierung für den Berichtszeitraum zum 31. Mai 2023.

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die wesentlichen aktiven Positionen, in denen der Fonds zum 31. Mai 2023 und zum 31. März 2023 übergewichtet (mit einem höheren Exposure als der Performanceindikator) und untergewichtet (mit einem niedrigeren Exposure als der Performanceindikator) war:

Größte übergewichtete Positionen			
31. Mai 2023		31. März 2023	
Land	Gewichtung	Land	Gewichtung
Brasilien	2,12 %	China	0,95 %
Indonesien	2,08 %	Taiwan	0,86 %
Polen	1,86 %	Indonesien	0,85 %

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio (Fortsetzung)

BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund (Fortsetzung)

Größte untergewichtete Positionen			
31. Mai 2023		31. März 2023	
Land	Gewichtung	Land	Gewichtung
Korea	2,12 %	Indien	2,02 %
Mexiko	1,86 %	Korea	1,26 %
Indien	1,00 %	Kuwait	0,94 %

Wenn der Fonds in einem Sektor untergewichtet war, (i) wirkt sich die Rendite aus diesem Sektor gegenläufig auf die aktive Rendite des Fonds aus. Dies kann (ii) dazu führen, dass ein Sektor zwar unter den Positivbeiträgen/Negativbeiträgen, jedoch nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte des Fonds aufgeführt wird.

FR Multi-Asset Fund

Im Geschäftsjahr bis zum 31. März 2024 betrug die Performance des Fonds 15,09 %. Die aktive Rendite lag bei 3,36 % und damit über seinem Performanceindikator, der 11,73 % auswies (die aktive Rendite entspricht der Differenz zwischen der Fondsrendite und der Rendite des Performanceindikators).

Im Berichtszeitraum profitierte der Fonds von einem signifikanten Positivbeitrag durch unsere taktische Ausrichtung auf festverzinsliche Anlagen, da wir während des gesamten Zeitraums auf den Zinskurven der USA, des Euro und Japans deutlich kurz aufgestellt waren, und zwar überwiegend am langen Ende. Auch wenn diese Positionierung im vierten Quartal 2023 Mühe hatte – die Zinssätze stiegen parallel zu den Erwartungen einer deutlichen Wende der Fed – war diese kurze Duration im ersten Quartal 2024 dann erneut positiv. Unsere Übergewichtung von Aktien war der relativen Performance im Berichtszeitraum ebenfalls förderlich, wobei die Übergewichtung von US-amerikanischen, europäischen und japanischen Aktien einen positiven Effekt gehabt hat.

Zudem profitierte der Fonds von dem positiven Alpha, das einige aktive Fonds generiert hatten, die wir für den Aufbau des Portfolios verwenden. Dies gilt insbesondere für den BlackRock Global Unconstrained Equity Fund.

Die folgenden Positionen lieferten im Verlauf des Geschäftsjahres die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Strategie	Auswirkung auf die Fondsrendite	Strategie	Auswirkung auf die Fondsrendite
BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund	3,08 %	Zahlungsmittel & Zahlungsmitteläquivalente	(0,87 %)
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	2,30 %	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	(0,45 %)
BlackRock Sustainable Equity Factor Plus	1,84 %	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr EUR Hedge	(0,05 %)
Global Unconstrained Equity Fund	1,39 %	iShares \$ TIPS UCITS ETF EUR Hedge	(0,03 %)
iShares MSCI World Value	0,52 %	iShares US MBS UCITS ETF	(0,02 %)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 31. März 2024 und 31. März 2023 angegeben:

31. März 2024		31. März 2023	
Strategie	Brutto engagement	Strategie	Brutto engagement
BlackRock Advantage US Equity Fund	9,90 %	BlackRock Advantage US Equity Fund	9,80 %
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	7,90 %	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	7,80 %
BlackRock Sustainable Equity Factor Plus	7,70 %	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus	5,50 %
iShares Core Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF	5,50 %	iShares Core Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF	5,50 %
BGF Emerging Market Fund	5,20 %	BGF Emerging Market Fund	5,20 %

BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026

Im Geschäftsjahr bis zum 31. März 2024 betrug die Rendite des Fonds 4,92 %.

Der Fonds verfolgt eine „Kaufen und Halten“-Strategie und orientiert sich an keiner Benchmark.

Der Fonds ist vollständig in auf Euro lautende Unternehmensanleihen investiert. Es kam zwar zu keinen größeren Kreditereignissen, doch veräußerte der Fonds einen italienischen Industrietitel, nachdem bekannt wurde, dass dieser möglicherweise das Ziel einer Übernahme sein könnte. Der Fonds konnte an demselben Tag einige Anteile zu unveränderten Kursen verkaufen und – zwecks Verbesserung des Ratings und um die Rendite zu steigern – in einige neue Emittenten aus dem Gesundheitswesen investieren. Die Marktbewegungen haben auch das Emittentenengagement verändert: Einige Anleihen haben sich gut entwickelt und dadurch ihre Gewichtung über den ursprünglich investierten Prozentsatz hinaus erhöht, und der Fonds nutzte kleine Abflüsse, um die Positionen in solchen Fällen zu reduzieren und die ursprüngliche Diversifizierung beizubehalten.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio (Fortsetzung)

BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 (Fortsetzung)

Die folgenden Positionen lieferten im Verlauf des Geschäftsjahres die größten Positiv- und Negativbeiträge zur Fondsrendite:

Größte Positivbeiträge		Größte Negativbeiträge	
Strategie	Auswirkung auf die Fondsrendite	Strategie	Auswirkung auf die Fondsrendite
Finanzunternehmen	2,44 %		
Industrie	1,48 %		
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	0,41 %		
Versorger	0,38 %		
Staatsnahe Titel	0,21 %		

Die Sektorallokation bei der Auflegung des Fonds war für den Fonds von Vorteil, da Finanzwerten die höchste Allokation zugewiesen worden war und der Sektor im Berichtszeitraum eine bessere Performance als Nicht-Finanzwerte erzielte. Die insgesamt positive Stimmung der Anleger während des Berichtszeitraums trug ebenfalls zur Fondsperformance bei, da sich die Anleger die hohen Renditen sichern wollten. Dies war insbesondere seit dem letzten Quartal des vergangenen Jahres der Fall, als die sinkende Inflation und die Positionen der Zentralbanken die Aufmerksamkeit der Märkte auf Zinssenkungen lenkten. Das Engagement bei staatsnahen Vermögenswerten trug ebenfalls positiv zur Wertentwicklung bei, wobei die insgesamt positive Risikostimmung die Performance der Anlageklasse unterstützte.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 31. März 2024 angegeben:

31. März 2024	
Sektor	Gewichtung
Finanzunternehmen	52,04 %
Industrie	32,90 %
Versorger	9,40 %
Staatsnahe Titel	5,62 %
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	0,04 %

BlackRock Advisors (UK) Limited
April 2024

BLACKROCK UCITS FUNDS

ERKLÄRUNG ÜBER DIE AUFGABEN DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

BlackRock Asset Management Ireland Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist verantwortlich für die Erstellung des Jahresberichts und des geprüften Jahresabschlusses gemäß geltendem irischem Recht und dem Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen für das Vereinigte Königreich und die Republik Irland geltenden Bilanzierungsstandard. Bei der Erstellung dieses Jahresabschlusses ist die Verwaltungsgesellschaft gehalten:

- geeignete Bilanzierungsgrundsätze auszuwählen und diese konsequent anzuwenden;
- angemessene und vorsichtige Beurteilungen und Schätzungen abzugeben;
- anzugeben, ob der Jahresabschluss im Einklang mit den anwendbaren Bilanzierungsgrundsätzen erstellt wurde, und die betreffenden Standards zu identifizieren, vorbehaltlich aller wesentlichen Abweichungen von diesen Standards, die in den Anmerkungen zum Jahresabschluss offengelegt und erklärt werden; und
- den Jahresabschluss auf Grundlage einer Fortführung der Geschäftstätigkeit zu erstellen, es sei denn, die Annahme, dass das Unternehmen seine Geschäftstätigkeit fortführt, ist nicht angemessen.

Die Verwaltungsgesellschaft ist für die ordnungsgemäße Führung der Geschäftsbücher verantwortlich, aus denen jederzeit mit angemessener Genauigkeit die Finanzlage des Unternehmens hervorgeht und aufgrund derer sie sicherstellen kann, dass der Abschluss gemäß FRS 102 erstellt wird und im Einklang mit den Bestimmungen des Unit Trusts Act von 1990 steht. Diesbezüglich hat die Verwaltungsgesellschaft die J.P. Morgan Administration Services (Ireland) Limited mit der Führung ordnungsgemäßer Bücher und der Erstellung der Abschlüsse beauftragt. Dementsprechend werden die Geschäftsbücher an folgender Adresse geführt:

200 Capital Dock
79 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 RK57
Irland

Darüber hinaus obliegt es der Verwaltungsgesellschaft, angemessene Maßnahmen zur Verhütung und Aufdeckung von Betrug und sonstigen Unregelmäßigkeiten zu treffen. Die Vermögenswerte des Unternehmens wurden dem Treuhänder zur Verwahrung anvertraut. Der Treuhänder ist J.P. Morgan SE – Zweigniederlassung Dublin. Deren Geschäftsadresse lautet wie folgt:

200 Capital Dock
79 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 RK57
Irland

Der Jahresabschluss für das Unternehmen und die begleitenden Anmerkungen und ungeprüften Informationen wurden vom Verwaltungsrat genehmigt.

Für die Verwaltungsgesellschaft

Verwaltungsratsmitglied

19. Juli 2024

Verwaltungsratsmitglied

19. Juli 2024

BLACKROCK UCITS FUNDS

BERICHT DES TREUHÄNDERS AN DIE ANTEILINHABER

In unserer Eigenschaft als Treuhänder des Unternehmens haben wir die Geschäftstätigkeit der BlackRock Asset Management Ireland Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) in Bezug auf den BlackRock UCITS Funds (das „Unternehmen“) im Geschäftsjahr zum 31. März 2024 überprüft.

Dieser Bericht inklusive des Prüfvermerks wird einzig und allein für die Anteilhaber des Unternehmens als Gesamtheit in Einklang mit den OGAW-Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 in der jeweils gültigen Fassung (die „Vorschriften“) und für keinen anderen Zweck vorgelegt. Durch Vorlage dieses Berichts übernehmen wir keine Verantwortung für einen anderen Zweck oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht gezeigt wird.

Gemäß unseren in den Vorschriften festgelegten Pflichten als Treuhänder haben wir uns einen Überblick über die Geschäftstätigkeit des Unternehmens in der Rechnungsperiode verschafft und berichten den Anteilhabern des Unternehmens darüber wie folgt.

Unseres Erachtens wurde das Unternehmen in dieser Rechnungsperiode in allen wesentlichen Aspekten gemäß den folgenden Bestimmungen geführt:

(i) gemäß den von den Gründungsdokumenten und den Vorschriften auferlegten Beschränkungen hinsichtlich der Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse der Verwaltungsgesellschaft und des Treuhänders; und

(ii) auch ansonsten gemäß den Bestimmungen der Gründungsdokumente und der Vorschriften.

Für und im Namen von

J.P. Morgan SE – Zweigniederlassung Dublin
200 Capital Dock
79 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 RK57
Irland

19. Juli 2024

BERICHT DER UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFER AN DIE ANTEILINHABER DER FONDS VON BLACKROCK UCITS FUNDS

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses Prüfvermerk

Auffassung

Wir haben den Abschluss der einzelnen Fonds von BlackRock UCITS Funds (die „Investmentgesellschaft“) für das am 31. März 2024 beendete Geschäftsjahr geprüft, der sich zusammensetzt aus den Abschlüssen des BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund, des BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1, des BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1, des BlackRock UK Credit Screened Fund, des BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund, des BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund, des BlackRock Diversifying Fixed Income Fund, des BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund, des BlackRock Global Equity Selection Fund, des BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund, des BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund, des BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund, des FR Multi-Asset Fund und des BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 (jeweils ein „Fonds“ und zusammen die „Fonds“).

Die Abschlüsse der Fonds setzen sich zusammen aus der Gewinn- und Verlustrechnung, der Eigenkapitalveränderungsrechnung, der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, der Bilanz, der Aufstellung der Vermögenswerte und den Anmerkungen zum Abschluss, einschließlich der in Anmerkung 2 enthaltenen Zusammenfassung wesentlicher Bilanzierungsgrundsätze. Der Jahresabschluss wurde gemäß geltender irischer Gesetze und FRS 102, dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen für das Vereinigte Königreich und die Republik Irland geltenden Bilanzierungsstandard, erstellt.

Unserer Auffassung nach vermittelt der Jahresabschluss:

- ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Finanzlage eines jeden Fonds zum 31. März 2024 und ihrer Ergebnisse für das dann endende Geschäftsjahr;
- wurde er gemäß den Bestimmungen von FRS 102, dem im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendende Bilanzierungsstandard, ordnungsgemäß aufgestellt; und
- wurde er gemäß den Bestimmungen des Unit Trust Act von 1990, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und den Central Bank (Supervision and Enforcement Act) 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2019 ordnungsgemäß aufgestellt.

Grundlage des Prüfvermerks

Wir haben unsere Prüfung gemäß den International Standards on Auditing (Ireland) (ISAs (Ireland)) und geltendem Recht durchgeführt. Unsere Aufgaben gemäß diesen Standards sind in unserem Bericht im Abschnitt über die Aufgaben der Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung genauer beschrieben. Gemäß den einschlägigen ethischen Anforderungen für unsere Abschlussprüfung in Irland, einschließlich der berufsethischen Standards der Irish Auditing and Accounting Supervisory Authority („IAASA“), sind wir von jedem der Fonds unabhängig und haben unsere sonstige ethische Verantwortung gemäß diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Überzeugung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise als Grundlage für unseren Prüfvermerk ausreichend und angemessen sind.

BERICHT DER UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFER AN DIE ANTEILINHABER DER FONDS VON BLACKROCK UCITS FONDS (FORTSETZUNG)

Hervorhebung eines Sachverhalts – nicht auf Basis der fortgeführten Geschäftstätigkeit erstellte Jahresabschlüsse bestimmter Fonds

Wir verweisen auf Anmerkung 2.1 des Abschlusses, in der erklärt wird, dass der BlackRock Diversifying Fixed Income Fund, der BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1, der BlackRock UK Credit Screened Fund, der BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond und der BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund vom Verwaltungsrat während des Jahres zur Schließung genehmigt wurden. Dementsprechend wurden die Abschlüsse dieser Fonds auf einer anderen Basis als der fortgeführten Geschäftstätigkeit erstellt, wie in Anmerkung 2.1 beschrieben. Unser Prüfvermerk ist diesbezüglich nicht eingeschränkt.

Schlussfolgerungen im Zusammenhang mit der fortgeführten Geschäftstätigkeit für alle anderen Fonds

Bei der Prüfung der Abschlüsse der Fonds, mit Ausnahme der im vorstehenden Abschnitt genannten Fonds, sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Verwendung des Grundsatzes der fortgeführten Geschäftstätigkeit durch die Verwaltungsgesellschaft bei der Erstellung des Abschlusses angemessen ist.

Auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen identifiziert, die entweder einzeln oder in ihrer Gesamtheit erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Fonds zur Fortführung der Geschäftstätigkeit für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum der Freigabe des Jahresabschlusses zur Veröffentlichung aufwerfen könnten.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten der Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf die fortgeführte Geschäftstätigkeit sind in den entsprechenden Abschnitten dieses Berichts beschrieben. Da jedoch nicht alle zukünftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhergesagt werden können, ist diese Erklärung keine Garantie für die Fähigkeit der Fonds, die Geschäftstätigkeit fortzuführen.

Sonstige Angaben

Die Verwaltungsgesellschaft ist für die sonstigen Angaben verantwortlich. Zu den sonstigen Angaben zählen die neben dem im Jahresabschluss und unserem Bericht des Abschlussprüfers im Jahresbericht enthaltenen Informationen. Unser Prüfvermerk zu den Abschlüssen erstreckt sich nicht auf die sonstigen Angaben, und dementsprechend erteilen wir darüber weder einen Prüfvermerk noch irgendein Urteil mit Prüfungssicherheit, sofern in diesem Bericht nicht ausdrücklich anders angegeben.

Es ist unsere Aufgabe, die sonstigen Angaben zu lesen und dabei zu prüfen, ob sie in wesentlichem Widerspruch zum Abschluss oder zu unseren im Zuge der Prüfung gewonnenen Erkenntnissen stehen oder ansonsten wesentliche Falschangaben zu enthalten scheinen. Stellen wir offensichtliche wesentliche Widersprüche oder wesentliche Falschangaben fest, sind wir verpflichtet, Verfahren einzusetzen, um zu entscheiden, ob wesentliche Falschangaben im Abschluss oder in den sonstigen Angaben vorliegen. Gelangen wir auf der Grundlage unserer ausgeführten Tätigkeiten zu dem Schluss, dass diese sonstigen Angaben wesentliche Falschangaben enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten.

Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Jeweilige Aufgaben

Aufgaben der Verwaltungsgesellschaft im Zusammenhang mit dem Jahresabschluss

Wie in der Erklärung über die Aufgaben der Verwaltungsgesellschaft auf Seite 20 näher erläutert, ist die Verwaltungsgesellschaft für die Aufstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den geltenden Rechnungslegungsvorschriften zuständig und muss sich vergewissern, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt. Sie ist außerdem für die nach ihrer Auffassung erforderlichen internen Kontrollen verantwortlich, um eine Aufstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die keine wesentlichen Falschangaben enthalten, ob aufgrund von Betrug oder Irrtum.

Bei der Aufstellung des Abschlusses ist die Verwaltungsgesellschaft dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Fonds zur Geschäftsfortführung zu beurteilen, gegebenenfalls Sachverhalte im Zusammenhang mit der Geschäftsfortführung anzugeben und bei der Bilanzierung von der Geschäftsfortführung auszugehen, sofern die Verwaltungsgesellschaft nicht beabsichtigt, die Fonds zu liquidieren oder den Betrieb einzustellen bzw. dazu keine realistische Alternative hat.

BERICHT DER UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFER AN DIE ANTEILINHABER DER FONDS VON BLACKROCK UCITS FUNDS (FORTSETZUNG)

Aufgaben der Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen Falschangaben ist, ob aufgrund von Betrug oder Irrtum, sowie einen Bericht der Abschlussprüfer herauszugeben, der unseren Prüfvermerk enthält. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Maß an Sicherheit, ist aber keine Garantie, dass eine gemäß den ISAs (Irland) durchgeführte Abschlussprüfung gegebenenfalls bestehende wesentliche Falschangaben in jedem Fall erkennt. Falschangaben können durch Betrug oder Irrtum entstehen und gelten als wesentlich, wenn davon auszugehen ist, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen der Adressaten beeinflussen.

Eine ausführlichere Beschreibung unserer Aufgaben im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung ist der Website der IAASA zu entnehmen unter: http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts der Abschlussprüfer.

Der Zweck unserer Prüfungshandlungen und wem gegenüber wir verantwortlich sind

Dieser Bericht ist einzig und allein für die Anteilhaber der Fonds als Gesamtheit in Einklang mit Vorschrift 93 der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 erstellt worden. Unsere Prüfungsarbeit wurde so durchgeführt, dass wir den Anteilhabern diejenigen Fakten mitteilen können, die ihnen in einem Bericht der Abschlussprüfer mitgeteilt werden müssen, nicht aber zu einem anderen Zweck. Soweit es das Gesetz zulässt, akzeptieren bzw. übernehmen wir die Verantwortung für unsere Prüfung, diesen Bericht bzw. die Meinungen, die wir uns gebildet haben, lediglich gegenüber den Fonds und den Anteilhabern der Fonds in ihrer Gesamtheit.



Ernst & Young Chartered Accountants
Dublin

Datum: 19. Juli 2024

BLACKROCK UCITS FUNDS

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	Anm.	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	
		2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP
Betriebliche Erträge	5	140	108	11.154	7.227	257	1.786	2.657	6.483
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	37.955	(5.578)	22.440	(45.714)	(671)	(19.286)	(168)	(35.972)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		38.095	(5.470)	33.594	(38.487)	(414)	(17.500)	2.489	(29.489)
Betriebliche Aufwendungen	6	(479)	(370)	(278)	(262)	(86)	(122)	(127)	(119)
Betriebliche Nettoerträge/ (-aufwendungen)		37.616	(5.840)	33.316	(38.749)	(500)	(17.622)	2.362	(29.608)
Finanzierungskosten:									
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	–	–	(1)	(1)	–	–	(1)	(2)
Finanzierungskosten insgesamt		–	–	(1)	(1)	–	–	(1)	(2)
Nettogewinn/(-verlust) vor Steuern		37.616	(5.840)	33.315	(38.750)	(500)	(17.622)	2.361	(29.610)
Besteuerung	10	–	–	(5)	(1)	–	(2)	–	–
Nettogewinn/(-verlust) nach Steuern		37.616	(5.840)	33.310	(38.751)	(500)	(17.624)	2.361	(29.610)
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		37.616	(5.840)	33.310	(38.751)	(500)	(17.624)	2.361	(29.610)

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

Außer den in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen Gewinnen und Verlusten gibt es im Geschäftsjahr keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste.

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	Anm.	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
		2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD
Betriebliche Erträge	5	2.372	1.739	1.974	1.967	762	1.072	8.044	12.736
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	2.826	(3.860)	(816)	(8.810)	3.589	(6.998)	17.252	(49.071)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		5.198	(2.121)	1.158	(6.843)	4.351	(5.926)	25.296	(36.335)
Betriebliche Aufwendungen	6	(158)	(173)	(270)	(255)	(245)	(271)	(1.318)	(2.017)
Betriebliche Nettoerträge/ (-aufwendungen)		5.040	(2.294)	888	(7.098)	4.106	(6.197)	23.978	(38.352)
Finanzierungskosten:									
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	(1)	(1)	(1)	(2)	–	–	(367)	(147)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	(73)	(49)	–	–	–	(125)	–	–
Finanzierungskosten insgesamt		(74)	(50)	(1)	(2)	–	(125)	(367)	(147)
Nettogewinn/(-verlust) vor Steuern		4.966	(2.344)	887	(7.100)	4.106	(6.322)	23.611	(38.499)
Besteuerung	10	–	–	(16)	(37)	–	–	(1.491)	(1.224)
Nettogewinn/(-verlust) nach Steuern		4.966	(2.344)	871	(7.137)	4.106	(6.322)	22.120	(39.723)
Berichtigung zur Anpassung an die im Prospekt beschriebene Bewertungsmethode		–	–	–	–	–	(6)	–	–
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		4.966	(2.344)	871	(7.137)	4.106	(6.328)	22.120	(39.723)

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

Außer den in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen Gewinnen und Verlusten gibt es im Geschäftsjahr keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste.

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	Anm.	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹		
		2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD	
Betriebliche Erträge	5	38	37	187	135	468	355	162	3.269	
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	5.902	(909)	3.231	(2.502)	6.367	(5.222)	(137)	(28.232)	
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		5.940	(872)	3.418	(2.367)	6.835	(4.867)	25	(24.963)	
Betriebliche Aufwendungen	6	(461)	(486)	(530)	(591)	(853)	(897)	(301)	(278)	
Betriebliche Nettoerträge/(-aufwendungen)		5.479	(1.358)	2.888	(2.958)	5.982	(5.764)	(276)	(25.241)	
Finanzierungskosten:										
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	–	–	–	–	–	(2)	(10)	(16)	
Finanzierungskosten insgesamt		–	–	–	–	–	(2)	(10)	(16)	
Nettogewinn/(-verlust) vor Steuern		5.479	(1.358)	2.888	(2.958)	5.982	(5.766)	(286)	(25.257)	
Besteuerung	10	–	–	–	–	–	–	1	(328)	
Nettogewinn/(-verlust) nach Steuern		5.479	(1.358)	2.888	(2.958)	5.982	(5.766)	(285)	(25.585)	
Berichtigung zur Anpassung an die im Prospekt beschriebene Bewertungsmethode	2	–	–	–	–	–	–	–	(8)	
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		5.479	(1.358)	2.888	(2.958)	5.982	(5.766)	(285)	(25.593)	

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

Außer den in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen Gewinnen und Verlusten gibt es im Geschäftsjahr keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste.

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

		FR Multi-Asset Fund 2024	FR Multi-Asset Fund 2023	BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹ 2024
	Anm.	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Betriebliche Erträge	5	1.192	246	7.394
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	33.832	(4.702)	3.583
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		35.024	(4.456)	10.977
Betriebliche Aufwendungen	6	(1.316)	(531)	(1.504)
Betriebliche Nettoerträge/ (-aufwendungen)		33.708	(4.987)	9.473
Finanzierungskosten:				
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	(2)	(1)	–
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	–	–	(846)
Finanzierungskosten insgesamt		(2)	(1)	(846)
Nettogewinn/(-verlust)		33.706	(4.988)	8.627
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		33.706	(4.988)	8.627

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

Außer den in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen Gewinnen und Verlusten gibt es im Geschäftsjahr keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste.

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

EIGENKAPITALVERÄNDERUNGSRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	
	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	147.003	107.521	500.760	491.376	80.280	151.866	124.726	258.941
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	37.616	(5.840)	33.310	(38.751)	(500)	(17.624)	2.361	(29.610)
Geschäfte mit Anteilen:								
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	4.000 –	48.000 –	262.596 (80.473)	112.587 (64.452)	113 (79.893)	733 (54.695)	– (127.087)	112 (104.717)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit Anteilen	4.000	48.000	182.123	48.135	(79.780)	(53.962)	(127.087)	(104.605)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9 –	(2.678)	–	–	–	–	–	–
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	188.619	147.003	716.193	500.760	–	80.280	–	124.726

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.
Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	84.045	92.491	96.813	103.950	66.646	90.067	245.584	384.733
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	4.966	(2.344)	871	(7.137)	4.106	(6.328)	22.120	(39.723)
Geschäfte mit Anteilen:								
Ausgabe rückkaufbarer Anteile	1.225	904	–	–	–	–	16.644	771
Rücknahme rückkaufbarer Anteile	(16.309)	(7.006)	(97.684)	–	(4.683)	(17.093)	(12.526)	(100.197)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit Anteilen	(15.084)	(6.102)	(97.684)	–	(4.683)	(17.093)	4.118	(99.426)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	73.927	84.045	–	96.813	66.069	66.646	271.822	245.584

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	29.680	33.555	35.681	42.318	90.456	87.605	11.594	270.128
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	5.479	(1.358)	2.888	(2.958)	5.982	(5.766)	(285)	(25.593)
Geschäfte mit Anteilen:								
Ausgabe rückkaufbarer Anteile	1.530	1.982	1.631	2.974	11.708	20.112	–	10.005
Rücknahme rückkaufbarer Anteile	(5.960)	(4.499)	(8.874)	(6.653)	(29.467)	(11.495)	(11.309)	(242.946)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit Anteilen	(4.430)	(2.517)	(7.243)	(3.679)	(17.759)	8.617	(11.309)	(232.941)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	30.729	29.680	31.326	35.681	78.679	90.456	–	11.594

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.
Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung) Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
	2024	2023	2024
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	298.050	–	–
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	33.706	(4.988)	8.627
Geschäfte mit Anteilen:			
Ausgabe rückkaufbarer Anteile	14.959	336.254	223.150
Rücknahme rückkaufbarer Anteile	(47.218)	(33.216)	(5.786)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit Anteilen	(32.259)	303.038	217.364
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	299.497	298.050	225.991

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor. Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BILANZ

Zum 31. März 2024

		BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	
	Anm.	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
		Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		3	20	85	–	80	13	218	–
Zahlungsmitteläquivalente		–	–	1.536	2.240	–	162	–	720
Bareinschüsse		–	–	111	272	–	–	–	–
Forderungen	11	13	10	15.523	6.173	–	3.400	11	2.130
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	188.919	147.147	707.639	495.908	–	79.517	–	122.365
Umlaufvermögen insgesamt		188.935	147.177	724.894	504.593	80	83.092	229	125.215
AKTIEN									
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	13	188.619	147.003	716.193	500.760	–	80.280	–	124.726
Eigenkapital insgesamt		188.619	147.003	716.193	500.760	–	80.280	–	124.726
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Kontokorrentkredit		–	–	–	6	–	–	–	2
Verbindlichkeiten	12	316	174	8.701	3.705	80	2.812	229	487
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	–	–	–	122	–	–	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		316	174	8.701	3.833	80	2.812	229	489
Eigenkapital und Verbindlichkeiten insgesamt		188.935	147.177	724.894	504.593	80	83.092	229	125.215

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.
Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 31. März 2024

	Anm.	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
		2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		117	173	149	1.613	10	11	5.126	3.855
Zahlungsmitteläquivalente		6	2.615	–	–	206	133	–	–
Bareinschüsse		49	–	–	–	–	–	177	181
Barsicherheiten		–	–	–	–	–	–	821	429
Forderungen	11	1.100	813	2	805	299	250	8.205	6.956
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	73.073	81.346	–	96.269	65.641	66.499	266.568	242.949
Umlaufvermögen insgesamt		74.345	84.947	151	98.687	66.156	66.893	280.897	254.370
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Zahlbare Bareinschüsse		21	–	–	–	–	–	15	147
Verbindlichkeiten	12	274	777	151	1.195	87	257	7.631	8.074
Rückstellung für latente Steuern auf Veräußerungsgewinne		–	–	–	–	–	–	748	90
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:	4	123	125	–	679	–	–	681	475
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		418	902	151	1.874	87	257	9.075	8.786
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen									
		73.927	84.045	–	96.813	66.069	66.636	271.822	245.584
Berichtigung zur Anpassung an die im Prospekt beschriebene Bewertungsmethode		–	–	–	–	–	10	–	–
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	13	73.927	84.045	–	96.813	66.069	66.646	271.822	245.584

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.
Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 31. März 2024

	Anm.	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
		2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		23	5	36	604	22	1.142	230	149
Bareinschüsse		–	–	–	–	–	–	–	95
Barsicherheiten		–	–	–	–	–	–	1	–
Forderungen	11	353	53	720	34	1.249	96	–	722
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	30.817	29.754	31.379	35.194	78.776	89.487	56	11.349
Umlaufvermögen insgesamt		31.193	29.812	32.135	35.832	80.047	90.725	287	12.315
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Kontokorrentkredit		–	18	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Bareinschüsse		–	–	–	–	–	–	–	8
Zahlbare Barsicherheiten		–	–	–	–	–	–	–	34
Verbindlichkeiten	12	464	114	786	151	1.297	269	287	658
Rückstellung für latente Steuern auf Veräußerungsgewinne		–	–	–	–	–	–	–	3
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:	4	–	–	23	–	71	–	–	18
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		464	132	809	151	1.368	269	287	721
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	13	30.729	29.680	31.326	35.681	78.679	90.456	–	11.594

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.
Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 31. März 2024

	Anm.	FR Multi-Asset Fund 2024 Tsd. EUR	FR Multi-Asset Fund 2023 Tsd. EUR	BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹ 2024 Tsd. EUR
UMLAUFVERMÖGEN				
Zahlungsmittel		7.229	5.170	26
Zahlungsmitteläquivalente		104	101	480
Bareinschüsse		1.577	1.755	–
Forderungen	11	11.561	822	2.743
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	299.370	296.279	223.332
Umlaufvermögen insgesamt		319.841	304.127	226.581
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN				
Zahlbare Bareinschüsse		69	203	–
Verbindlichkeiten	12	11.699	3.000	579
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:	4	8.576	2.874	11
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		20.344	6.077	590
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	13	299.497	298.050	225.991

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor. Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS

1. Allgemeine Informationen

Das Unternehmen ist eine offene Investmentgesellschaft (Unit Trust) mit Sitz in Irland und nach irischem Recht als Unit Trust organisiert. Das Unternehmen ist von der CBI zugelassen und unterliegt den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften.

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

2.1 Grundlage für die Aufstellung des Abschlusses

Der Abschluss wird gemäß Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen, für das Vereinigte Königreich und die Republik Irland geltenden Bilanzierungsstandard, aufgestellt.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die erfolgswirksame Neubewertung der zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten und auf Basis der fortgeführten Geschäftstätigkeit. Am 15. Dezember und am 25. Oktober 2023 traf der Verwaltungsrat die Entscheidung, den BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 und den BlackRock UK Credit Screened Fund mit Wirkung vom 30. November bzw. 6. Dezember 2023 zu schließen. Am 21. März 2023 traf der Verwaltungsrat die Entscheidung, den BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund mit Wirkung vom 27. Juni 2023 zu schließen. Am 14. Februar 2024 traf der Verwaltungsrat die Entscheidung, den BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund mit Wirkung vom 20. März 2024 zu schließen. Am 23. Januar 2024 traf der Verwaltungsrat die Entscheidung, den BlackRock Diversifying Fixed Income Fund mit Wirkung vom 17. Juli 2024 zu schließen. Deshalb wurden die Abschlüsse des BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1, des BlackRock UK Credit Screened Fund, BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond, des BlackRock Diversifying Fixed Income Fund und des BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund auf der Basis der nicht fortgeführten Geschäftstätigkeit erstellt. Für jene Fonds, die auf der Basis der nicht fortgeführten Geschäftstätigkeit erstellt wurden, werden die finanziellen Vermögenswerte zu erzielbaren Beträgen und die Verbindlichkeiten zu den vertraglichen Abwicklungsbeträgen verbucht. Liquidationskosten werden zusätzlich eingeschlossen, wenn sie wesentlich sind.

Das Unternehmen hat von der in Section 7 des FRS 102 enthaltenen Ausnahmeregelung für offene Investmentfonds, die einen wesentlichen Anteil an hoch liquiden und zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen enthalten, Gebrauch gemacht und legt keine Kapitalflussrechnung vor.

Das Format und bestimmte Passagen des Wortlauts des Jahresabschlusses weichen in bestimmten Punkten von den in Section 3 des FRS 102 enthaltenen ab, sodass sie nach Auffassung des Verwaltungsrats besser den geschäftlichen Charakter des Unternehmens als ein Investmentfonds widerspiegeln.

Die wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze und Anmerkungen, die alle für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 gelten, sind nachstehend aufgeführt.

Alle Beträge wurden auf Tausend gerundet, sofern nicht anders angegeben.

2.2 Finanzinstrumente

Das Unternehmen hat sich entschieden, die Ansatz- und Bewertungsbestimmungen von IAS 39 und lediglich die Angabepflichten von Section 11 und 12 von FRS 102 anzuwenden, da sie sich auf Finanzinstrumente beziehen.

2.2.1 Klassifizierung

Das Unternehmen klassifiziert seine Anlagen in Schuldtiteln, Aktieninstrumenten und Derivaten als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten. Diese finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten werden als zu Handelszwecken gehalten klassifiziert oder vom Verwaltungsrat beim Erstansatz erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzt. Sämtliche derivativen Instrumente werden zu Handelszwecken gehalten. Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten, einschließlich Zahlungsmitteln, Zahlungsmitteläquivalenten, Forderungen und Verbindlichkeiten, werden zu fortgeführten Anschaffungskosten unter Anwendung der Effektivzinsmethode klassifiziert.

2.2.2 Erfassung und Ausbuchung

Das Unternehmen erfasst einen finanziellen Vermögenswert oder eine finanzielle Verbindlichkeit, wenn es Partei der vertraglichen Bestimmungen des Instruments wird. Käufe und Verkäufe von Anlagen werden an dem Tag erfasst, an dem der Handel stattfindet.

Realisierte Gewinne und Verluste aus der Veräußerung von Finanzinstrumenten werden anhand der Methode der gewichteten Durchschnittskosten ermittelt. Bei long gehaltenen Instrumenten stellen sie die Differenz zwischen dem ursprünglichen Buchwert und dem Veräußerungsbetrag dar. Bei short gehaltenen Instrumenten stellen sie die Differenz zwischen dem erhaltenen Erlös und dem Eröffnungswert dar. Bei Derivatkontrakten stellen sie die Barzahlungen oder -einnahmen aus derivativen Kontrakten dar (mit Ausnahme derjenigen auf Sicherheiten- oder Margenkonten für solche Instrumente).

Finanzielle Vermögenswerte werden ausgebucht, wenn die Rechte auf Cashflows aus den Vermögenswerten ausgelaufen sind oder im Wesentlichen alle Risiken und Chancen, die mit dem Eigentum dieser Anlagen verbunden sind, übertragen wurden. Finanzielle Verbindlichkeiten werden ausgebucht, wenn die Verpflichtung im Rahmen der Verbindlichkeit erfüllt, außer Kraft gesetzt oder erloschen ist.

2.2.3 Bemessungsgrundlage

Alle Finanzinstrumente werden erstmalig zum beizulegenden Zeitwert erfasst.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten werden in Folgeperioden zum beizulegenden Zeitwert angesetzt. Transaktionskosten bei Käufen oder Verkäufen von Anlagen sowie Gewinne und Verluste aus Änderungen des beizulegenden Zeitwerts von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten oder finanziellen Verbindlichkeiten werden in der Gewinn- und Verlustrechnung in dem Zeitraum, in dem sie entstehen, unter „Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten“ ausgewiesen.

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, mit Ausnahme der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten, werden in Folgeperioden zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.2 Finanzinstrumente (Fortsetzung)

2.2.4 Bestimmung des beizulegenden Zeitwertes

Der beizulegende Zeitwert ist der Betrag, zu dem ein Vermögenswert zwischen fachkundigen, vertragswilligen und voneinander unabhängigen Parteien getauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein gewährtes Eigenkapitalinstrument zu marktüblichen Bedingungen getauscht werden könnte. Die Bestimmung des beizulegenden Zeitwertes erfolgt nach dem erstmaligen Ansatz wie folgt:

- Anlagen in Schuld- und Aktieninstrumenten sowie börsengehandelten Derivatekontrakten, die an einem Markt oder einer Börse notiert oder gehandelt werden, werden auf der Grundlage der notierten Preise bewertet, die zu Abschlusszwecken der im Prospekt des Unternehmens beschriebenen Bewertungsmethode entsprechen. Je nach Art der zugrunde liegenden Anlage kann der Wert entweder zum Schlusskurs, zum Mittelkurs bei Handelsschluss oder zum Geldkurs am jeweiligen Markt ermittelt werden.
- Die Bewertung von Anlagen in börsengehandelte Fonds („ETF“), die an einem Markt oder einer Börse notiert, gelistet oder gehandelt werden, erfolgt auf der Grundlage der notierten Marktpreise bewertet, es sei denn, der Fonds handelt die von ihm gehaltenen Anteile in der Regel zum letzten NIW für diesen ETF. In solchen Fällen wird die Anlage in den ETF auf der Grundlage des letzten NIW des jeweiligen ETF bewertet.
- Anlagen in zentral geclearten und außerbörslichen („OTC“) Derivaten und Anlagen, bei denen es sich um einen Beteiligungsanteil an einem Investmentfonds („CIS“) handelt, werden mittels Bewertungstechniken bewertet.

Im Fall einer Anlage, die nicht an einem anerkannten Markt notiert oder gehandelt wird oder für die zum Zeitpunkt der Bewertung kein notierter oder gehandelter Kurs bzw. keine notierte oder gehandelte Quotierung verfügbar ist, wird der beizulegende Zeitwert mit der gebotenen Sorgfalt und nach Treu und Glauben durch eine hierfür fachlich qualifizierte Person, Einrichtung, Firma oder Körperschaft (die zu diesem Zweck durch den Verwaltungsrat in Rücksprache mit dem Investmentmanager beauftragt und zu diesem Zweck durch den Treuhänder genehmigt wird) ermittelt. Dieser beizulegende Zeitwert wird anhand von Bewertungstechniken ermittelt. Das Unternehmen verwendet eine Vielzahl von Methoden und trifft Annahmen, die auf den zu jedem Berichtsdatum bestehenden Marktbedingungen basieren.

Zu den Bewertungsmethoden für nicht standardisierte Finanzinstrumente wie OTC-Derivate gehören die in der Zeitwerthierarchie erläuterten und die von den Marktteilnehmern verwendeten Techniken, die die Marktdaten so weit wie möglich nutzen und sich so wenig wie möglich auf unternehmensspezifische Daten stützen.

2.2.5 Finanzderivate und andere spezifische Instrumente

2.2.5.1 Terminkontrakte (Futures)

Ein Terminkontrakt (Future) ist ein Kontrakt, der an einer Börse gehandelt wird und mit dem ein bestimmter Basiswert an einem bestimmten Termin in der Zukunft zu einem festgelegten Preis gekauft oder verkauft wird.

Erste Einschusszahlungen werden an die jeweiligen Makler bei Abschluss von Terminkontrakten geleistet und sind im Bareinschuss enthalten.

2.2.5.2 Devisenterminkontrakte

Ein Devisenterminkontrakt ist ein Vertrag (am OTC-Markt) zwischen zwei Parteien über den Kauf oder Verkauf einer bestimmten zugrunde liegenden Währung zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt zu einem festgelegten Preis.

2.2.6 Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Zahlungsmittel in der Bilanz beinhalten sofort verfügbare Bareinlagen bei Banken. Zahlungsmitteläquivalente sind u. a. kurzfristige liquide Anlagen, die jederzeit in einen bekannten Barbetrag umgewandelt werden können und unerheblichen Wertänderungsrisiken unterliegen und die ursprüngliche Laufzeiten von drei Monaten oder weniger haben.

Kontokorrentkredite bei Banken werden in der Bilanz als Verbindlichkeiten ausgewiesen.

2.2.7 Sachsicherheiten und Barsicherheiten

Vom Fonds bereitgestellte Barsicherheiten werden in der Bilanz als Vermögenswert unter „Barsicherheiten“ ausgewiesen und werden nicht als Komponente der Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente berücksichtigt.

Barguthaben zum Ende des Berichtszeitraums, die als Margin bei entsprechenden Maklern im Zusammenhang mit Anlagen in Derivaten gehalten werden, sind in der Bilanz als „Bareinschüsse“ ausgewiesen.

Dem Fonds von Kontrahenten zur Verfügung gestellte Barsicherheiten werden in der Bilanz als „Verbindlichkeiten aus Barsicherheiten“ ausgewiesen. Der Fonds kann diese Barsicherheiten neu anlegen, und die gekauften Vermögenswerte werden in der Bilanz als „Zahlungsmitteläquivalente“ ausgewiesen.

2.2.8 Rückkaufbare Anteile

Jeder Fonds klassifiziert rückkaufbare Anteile als finanzielle Verbindlichkeiten oder Eigenkapital entsprechend den vertraglichen Bestimmungen der Instrumente. Rückkaufbare Anteile werden mit dem Barwert der Rückzahlungsbeträge bewertet.

Anteile am BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund, BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund, BlackRock Diversifying Fixed Income Fund, BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund, BlackRock Global Equity Selection Fund, BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund, BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund, BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund, FR Multi-Asset Fund und am BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 können auf Wunsch der Inhaber zurückgenommen werden und erfüllen nicht die Bedingungen aus Section 22.4 von FRS 102 für eine Klassifizierung als Eigenkapital. Daher werden sie als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Alle anderen Fonds erfüllen die Anforderungen und werden als Eigenkapital klassifiziert.

Die rückkaufbaren Anteile werden an dem Tag erfasst, an dem der Handel erfolgt. Zeichnungen und Rücknahmen rückkaufbarer Anteile werden an dem Tag erfasst, an dem die Handelstransaktion stattfindet. Anteile werden basierend auf dem NIW je Anteil zum letzten Bewertungszeitpunkt gezeichnet und zurückgenommen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.2 Finanzinstrumente (Fortsetzung)

2.2.8 Rückkaufbare Anteile (Fortsetzung)

Fallen im Zusammenhang mit einer Zeichnung oder Rücknahme Steuern und Abgaben an, wirken sich diese auf den Wert einer Anlage eines zeichnenden oder zurückgebenden Anlegers aus und werden folglich als Teil der Ausgabe rückkaufbarer Anteile bzw. Rücknahme rückkaufbarer Anteile in der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens und der Eigenkapitalveränderungsrechnung ausgewiesen. Mögliche Abgaben und Gebühren liegen im Ermessen des Verwaltungsrats.

2.3 Fremdwährungen

2.3.1 Funktionale Währung und Darstellungswährung

Im Abschluss der einzelnen Fonds ausgewiesene Fremdwährungspositionen werden unter Verwendung der in den Überschriften des Abschlusses angegebenen jeweiligen funktionalen Währung jedes Fonds bewertet.

Der Verwaltungsrat ist der Ansicht, dass diese Währungen die wirtschaftlichen Auswirkungen der zugrunde liegenden Transaktionen, Ereignisse und Bedingungen jedes Fonds am besten widerspiegeln. Die Darstellungswährung der einzelnen Fonds entspricht der funktionalen Währung.

2.3.2 Transaktionen und Salden

Transaktionen in Fremdwährungen werden in die funktionale Währung des jeweiligen Fonds zu dem zum Zeitpunkt der Transaktion geltenden Wechselkurs umgerechnet.

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen, einschließlich Anlagen, werden zu dem am Bilanzstichtag geltenden Wechselkurs umgerechnet.

Der Fremdwährungsgewinn oder -verlust auf der Grundlage der Umrechnung der Anlagen sowie der aus der Umrechnung anderer Vermögenswerte und Verbindlichkeiten entstehende Gewinn oder Verlust werden in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen.

2.4 Kritische Bilanzschätzungen und -beurteilungen

Für die Erstellung von Abschlüssen in Übereinstimmung mit FRS 102 müssen einige kritische Bilanzschätzungen angewandt werden. Die Verwaltungsratsmitglieder müssen darüber hinaus bei der Anwendung der Bilanzierungsgrundsätze des Unternehmens ihr Urteilsvermögen einsetzen. Änderungen der Annahmen können in dem Zeitraum, in dem sie auftreten, einen wesentlichen Einfluss auf den Abschluss haben. Der Verwaltungsrat vertritt die Ansicht, dass die zugrunde liegenden Annahmen angemessen sind und dass der Abschluss des Unternehmens daher dessen Finanzlage und Ergebnisse angemessen darstellt. Die Schätzungen und die zugrunde liegenden Annahmen werden laufend überprüft. Änderungen von Bilanzschätzungen werden in der Periode erfasst, in der die Schätzung geändert wird, wenn die Änderung nur diese Periode betrifft, oder in der Periode der Änderung und in zukünftigen Jahren, wenn die Änderung sowohl das laufende als auch zukünftige Jahre betrifft. Bereiche mit höheren Beurteilungsspielräumen oder Komplexität oder Bereiche, in denen Annahmen und Schätzungen für den Abschluss wesentlich sind, werden im Folgenden aufgeführt.

2.4.1 Annahmen und Schätzungsunsicherheiten

2.4.1.1 Zeitwert der OTC-DFI

OTC-DFI werden mit Hilfe von Bewertungstechniken bewertet, wie sie in den Angaben zur Zeitwerthierarchie dargelegt sind. Werden zur Bestimmung von Zeitwerten Bewertungstechniken (z. B. Modelle) verwendet, werden diese validiert und periodisch überprüft und, soweit verfügbar, mit dem Preis einer unabhängigen Preisagentur verglichen.

2.4.1.2 Zeitwert von nicht an einem aktiven Markt notierten Finanzinstrumenten

Der beizulegende Zeitwert solcher Instrumente, die nicht an einem aktiven Markt notiert sind, kann vom Fonds unter Verwendung seriöser Preisquellen oder indikativer Preise von Market Makers für Anleihen/Kredite bestimmt werden. Der Fonds würde Beurteilungen und Schätzungen zur Quantität und Qualität der verwendeten Preisquellen vornehmen. Preisnotierungen von Maklern aus den Preisquellen können indikativ und nicht ausführbar oder verbindlich sein.

2.4.1.3 Zeitwert von Finanzinstrumenten mit maßgeblichen nicht beobachtbaren Parametern

Der beizulegende Zeitwert solcher Instrumente wird unter Verwendung von Bewertungstechniken bestimmt, einschließlich von Daten, die nicht auf Marktdaten basieren und bei denen wesentliche, vom Unternehmen bestimmte Anpassungen oder Annahmen getroffen werden, wie in den Angaben zur Zeitwerthierarchie im Jahresabschluss erläutert.

Einzelheiten zur Bewertungstechnik und zu den nicht beobachtbaren Parametern, die bei der Bewertung von Aktien verwendet werden, sind in der Anmerkung zur Zeitwerthierarchie im Abschluss dargelegt.

2.4.2 Beurteilungen

2.4.2.1 Bewertung als Anlageunternehmen

Der Verwaltungsrat ist der Meinung, dass das Unternehmen der Definition eines Anlageunternehmens entspricht. Die folgenden Bedingungen liegen vor:

- a. das Unternehmen hat Mittel zum Zweck der Bereitstellung von Anlageverwaltungsdiensten für Anleger erhalten; und
- b. die vom Unternehmen gehaltenen Anlagen werden auf Zeitwertbasis gemessen und bewertet, und Informationen über diese Anlagen werden den Anteilinhabern durch das Unternehmen auf Zeitwertbasis zur Verfügung gestellt.

2.5 Dividendenerträge

Dividendenerträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst, wenn das Recht des Fonds auf Erhalt der Zahlung begründet wird. Bei börsennotierten Beteiligungspapieren ist dies in der Regel der Ex-Dividendtag. Bei nicht börsennotierten Beteiligungspapieren ist dies in der Regel der Tag, an dem die Anteilinhaber die Zahlung einer Dividende genehmigen. Die Dividendenerträge sind einschließlich der nicht erstattungsfähigen Quellensteuern ausgewiesen, die in der Gewinn- und Verlustrechnung getrennt aufgeführt sind. CIS-Erträge werden ausgewiesen, wenn die Ausschüttungen durch den zugrunde liegenden CIS beschlossen werden. ETF-Erträge werden am Ex-Tag erfasst.

Bei Schuldtiteln wird jede Differenz zwischen den Anschaffungskosten und dem Wert zur Fälligkeit über die Laufzeit des Wertpapiers als Zinsertrag verbucht, wobei die Amortisation auf der Grundlage der Effektivrendite berechnet wird.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.6 Zinserträge und Zinsaufwendungen

Zinserträge und -aufwendungen für alle verzinslichen Finanzinstrumente werden unter Anwendung der Effektivzinsmethode in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

2.7 Erträge aus der Wertpapierleihe

Erträge aus der Wertpapierleihe entstehen durch den Verleih von Wertpapieren im Eigentum des Fonds an Drittleiher. Alle Erträge aus der Wertpapierleihe, abzüglich der Gebühren des Vermittlers für Wertpapierleihen, werden in der Gewinn- und Verlustrechnung periodengerecht ausgewiesen.

2.8 Gebühren und Aufwendungen

Aufwendungen werden periodengerecht in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen, mit Ausnahme von Transaktionskosten für den Kauf und Verkauf von Anlagen, die zum Zeitpunkt, zu dem sie anfallen, erfasst und in dem Zeitraum, in dem sie entstehen, unter „Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten“ ausgewiesen werden.

Aufwendungen, die direkt einer bestimmten Anteilklasse zuzuordnen sind, werden ausschließlich von dieser Anteilklasse getragen.

2.9 Ausschüttungen

Ausschüttungen werden in der Gewinn- und Verlustrechnung als Finanzierungskosten erfasst, wenn Fondsanteile nicht die Bedingungen für eine Klassifizierung als Eigenkapital erfüllen, und werden daher als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Alle verbleibenden Ausschüttungen werden in der Eigenkapitalveränderungsrechnung ausgewiesen.

Der Verwaltungsrat kann Ausschüttungen auf die Anteile der jeweiligen Klasse in Hinblick auf jeden Berichtszeitraum beschließen. Ausschüttungen können aus dem Nettoertrag des Fonds erfolgen. Darüber hinaus kann der Verwaltungsrat Ausschüttungen auf die Anteile der Klasse Institutional Distribution des BlackRock Canguard Global Index Equity Fund, auf die Anteile der Klasse D Distributing des BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund, auf die Anteile der Klasse Institutional 1 Distributing Unit Class und der Klasse Institutional 2 Distributing Unit Class des BlackRock Diversifying Fixed Income Fund und die Klasse C CHF Hedged Distributing, die Klasse C EUR Distributing, die Klasse C USD Hedged Distributing, die Klasse EUR Distributing und die Klasse E EUR Distributing des BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 und auf die Anteile der Klassen Institutional 2 Distributing und Institutional 2 Distributing des BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 aus dem Kapital erklären, um sicherzustellen, dass eine Ausschüttung an die Anteilinhaber erfolgt.

Um sicherzustellen, dass die Höhe der aus Anlagen erzielten Erträge nicht durch die Ausgabe, Umschichtung oder Rücknahme von Anteilen während des Geschäftsjahres beeinflusst wird, hat der Verwaltungsrat Ertragsausgleichsbestimmungen implementiert. Im Rahmen der Ausschüttungszahlung wird der Durchschnittsbetrag dieses Ertragsausgleichs an die Anteilinhaber, die während des Geschäftsjahres Anteile des Fonds gezeichnet oder zurückgegeben haben, angepasst. Der Ausgleichsanteil der Ausschüttung wird als eine Kapitalrückzahlung behandelt.

Es erfolgen keine Ausschüttungen an Anteilinhaber der thesaurierenden Anteilklassen. Die Erträge und sonstigen Gewinne werden thesauriert und für die jeweiligen Anteilinhaber in den Fonds reinvestiert.

2.10 Besteuerung

2.10.1 Tatsächliche Steuern

Tatsächliche Steuern werden in Höhe des Betrags ausgewiesen, der für Einkommenssteuern auf im Ausland steuerbare Gewinne für die aktuellen oder frühere Berichtszeiträume zahlbar ist, und zwar anhand der Steuersätze und Gesetze, die spätestens am Bilanzstichtag gelten oder in Kürze gelten werden.

2.11 Änderungen in der Rechnungslegung

2.11.1 Änderung in der Rechnungslegung – OTC-Derivate: Differenzkontrakte („CFD“)

Grund für die Änderung in der Rechnungslegung

Anlagen in bestimmten OTC-Derivaten, insbesondere CFDs, erfüllen ihrem Wesen und ihren Merkmalen nach die entscheidenden Kriterien für einen Swap und sind daher zutreffender als Swaps einzustufen.

Auswirkungen der Änderung in der Rechnungslegung

Die Änderung hatte keine Auswirkungen auf den NIW des Fonds beziehungsweise die Darstellung der Salden. Anlagen in diesen OTC-Derivaten werden in der Bilanz weiterhin als „Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ beziehungsweise als „Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ klassifiziert. Die Änderung hatte auch keine zahlenmäßigen Effekte auf die verkürzte Gewinn- und Verlustrechnung beziehungsweise die Anmerkungen zum Abschluss.

3. Finanzielle Risiken

Die Anlageaktivitäten jedes Fonds setzen diesen verschiedenen Typen von Risiken aus, die mit den Finanzinstrumenten und den Märkten, in die er investiert, verknüpft sind. Die nachfolgende Zusammenfassung soll keinen umfassenden Überblick über alle Risiken darstellen. Anleger sollten für eine detailliertere Erörterung der mit Anlagen in den einzelnen Fonds verbundenen Risiken den Prospekt zurate ziehen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.1 Risikomanagementrahmen

Die Verwaltungsgesellschaft prüft die Quartalsberichte zum Anlageergebnis vierteljährlich und erhält halbjährlich eine Präsentation des Investmentmanagers zur Wertentwicklung des Unternehmens sowie zum Risikoprofil während des Berichtszeitraums. Der Verwaltungsrat hat bestimmte Aufgaben in Bezug auf das Tagesgeschäft des Unternehmens auf die Verwaltungsgesellschaft übertragen. Die Verwaltungsgesellschaft wiederum hat die laufende Verwaltung des Anlageprogramms an den Investmentmanager delegiert. Der Anlageausschuss der Verwaltungsgesellschaft prüft die jährlichen Berichte über die Performance der Investitionen und erhält vierteljährlich Präsentationen, die alle wesentlichen Entwicklungen in Bezug auf die Wertentwicklung und das Risikoprofil der Gesellschaft während des Geschäftsjahres enthalten. Der Investmentmanager ist ferner dafür verantwortlich sicherzustellen, dass das Unternehmen gemäß den im Prospekt aufgeführten Anlagerichtlinien und -beschränkungen verwaltet wird. Die Verwaltungsgesellschaft ist für das Anlageergebnis und die Überwachung und Kontrolle des Produkttrisikos zuständig und trägt die Verantwortung für die Überwachung und Kontrolle des regulatorischen und betrieblichen Risikos für das Unternehmen. Die Verwaltungsgesellschaft hat einen Risikomanager bestellt, der für den täglichen Risikomanagementprozess zuständig ist. Unterstützt wird er dabei von maßgeblichen Risikomanagement-Mitarbeitern des Investmentmanagers einschließlich Mitgliedern der Risk and Quantitative Analysis Group von BlackRock („RQA Group“), einer zentralisierten Gruppe, die unabhängige Risikomanagementfunktionen übernimmt. Die RQA Group ermittelt, misst und überwacht Anlagerisiken, einschließlich klimabezogener Risiken, unabhängig. Die RQA Group verfolgt die tatsächlich vom Fonds eingesetzten Risikomanagementverfahren. Durch Aufgliederung der Komponenten des Prozesses kann die RQA Group feststellen, ob vom Fonds angemessene Risikomanagementprozesse eingerichtet sind. Dabei werden die eingesetzten Risikomanagementinstrumente ebenso berücksichtigt wie die Art und Weise der Steuerung des Risikoniveaus, die Gewährleistung der Berücksichtigung von Risiko/Ertrag beim Portfolioaufbau und die Überprüfung der Ergebnisse.

3.2 Marktrisiko

Marktrisiken ergeben sich hauptsächlich aus der Unsicherheit im Hinblick auf die zukünftigen Werte von Finanzinstrumenten, die durch Währungs- und Zinsveränderungen sowie Preisbewegungen beeinflusst werden. Sie entsprechen dem möglichen Verlust der einzelnen Fonds aus ihren Anlagen bei Marktbewegungen.

Jeder Fonds ist durch seine Anlagen in Schuldtiteln, Aktieninstrumenten und Derivaten einem Marktrisiko ausgesetzt.

Eine maßgebliche Kennzahl der RQA Group zur Messung des Marktrisikos ist Value-at-Risk („VaR“), das Währungs- und Zinsrisiken sowie Preisbewegungen umfasst. VaR ist ein statistisches Risikomaß, das den potenziellen Portfolioverlust durch nachteilige Marktbewegungen in einem gewöhnlichen Marktumfeld misst. Im Gegensatz zu traditionellen Sensitivitätsanalysen reflektiert die VaR-Analyse die Wechselwirkungen zwischen Risikovariablen.

Die VaR-Berechnungen basieren auf einem angepassten, historischen Simulationsmodell mit einem Konfidenzniveau von 99 %, einer Haltedauer von einem Tag und einem historischen Beobachtungszeitraum von mindestens 1 Jahr (250 Tage). Ein VaR-Wert wird anhand einer gegebenen Wahrscheinlichkeit und eines gegebenen Zeithorizonts ermittelt. Ein VaR mit einem Konfidenzniveau von 99 % und einer Haltedauer von einem Tag bedeutet, dass der mögliche Verlust des Fonds von einem Tag zum nächsten mit einer Wahrscheinlichkeit von 99 % diesen Wert in Prozent nicht überschreiten wird. Höhere VaR-Werte deuten deshalb auf ein höheres Risiko hin. Der eintägige VaR hat einen mehrjährigen Rückblickszeitraum, der die durch politische, soziale und wirtschaftliche Ereignisse verursachte Marktvolatilität umfasst, die in das Modell einfließt. Erhebliche Marktstörungen, wie beispielsweise durch Pandemien, Natur- oder Umweltkatastrophen, Krieg, Terroranschläge oder andere Ereignisse, können den VaR des Fonds negativ beeinflussen.

Die Verwendung der VaR-Methodik hat allerdings Grenzen, und zwar insofern, als der Einsatz historischer Daten als Grundlage zur Einschätzung künftiger Ereignisse nicht sämtliche Szenarien berücksichtigt, insbesondere nicht solche extremer Natur, und dass die Verwendung eines spezifischen Konfidenzniveaus (z. B. 99 %) Verluste, die über dieses Niveau hinausgehen, nicht einbezieht. Es besteht eine gewisse Wahrscheinlichkeit, dass die Verluste größer ausfallen könnten als die VaR-Beträge. Durch diese Einschränkungen und die Natur des VaR-Maßstabs kann der jeweilige Fonds weder garantieren, dass die Verluste die angegebenen VaR-Beträge nicht übersteigen, noch, dass es nicht häufiger zu Verlusten kommen könnte, die die VaR-Beträge übersteigen.

Der Ein-Tages-VaR basierend auf einem Konfidenzniveau von 99 % ist in der Tabelle unten dargelegt:

Name des Fonds	2024 %	2023 %
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	2,28	3,35
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	0,55	1,22
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹	k. A.	1,66
BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	k. A.	1,48
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	0,30	0,61
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹	k. A.	0,99
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	0,54	1,00
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	2,17	3,34
BlackRock Global Equity Selection Fund	1,97	3,17
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	0,94	1,38
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	0,74	0,99
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	k. A.	3,28
FR Multi-Asset Fund	1,68	2,42
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ²	0,27	k. A.

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

² Der Fonds wurde im Berichtszeitraum aufgelegt, deshalb liegen keine Vergleichsdaten vor.

3.2.1 Aus dem Fremdwährungsrisiko entstehendes Marktrisiko

Das Fremdwährungsrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder künftige Cashflows eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Wechselkurse schwanken.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.2 Marktrisiko (Fortsetzung)

3.2.1 Aus dem Fremdwährungsrisiko entstehendes Marktrisiko (Fortsetzung)

Bestehende Liquiditätsrisiken

Jeder Fonds kann in Finanzinstrumente investieren, die auf andere Währungen als seine funktionale Währung lauten. Daher ist jeder Fonds dem Risiko ausgesetzt, dass sich der Wechselkurs seiner funktionalen Währung gegenüber anderen Währungen direkt und/oder indirekt in einer Weise ändern kann, die nachteilige Auswirkungen auf den Wert des Teils des Fondsvermögens hat, der auf andere Währungen als seine eigene Währung lautet.

Die Einzelheiten zu den am Ende des Geschäftsjahresende bestehenden, der Absicherung des Fremdwährungsrisikos dienenden offenen Devisenterminkontrakten sind in den Vermögensaufstellungen offengelegt.

Alle oder im Wesentlichen alle Anlagen der einzelnen Fonds lauten auf die funktionale Währung des jeweiligen Fonds und waren daher zum 31. März 2024 und zum 31. März 2023 keinem direkten Fremdwährungsrisiko ausgesetzt.

Steuerung des Fremdwährungsrisikos

Jeder Fonds kann Fremdwährungen absichern, um den Einfluss von Wechselkursschwankungen zwischen den Währungen der vom Fonds gehaltenen Anlagen und den währungsgesicherten Anteilklassen des Fonds zu minimieren.

Der Investmentmanager überwacht das Fremdwährungsrisiko anhand vorgegebener Toleranzen und bestimmt, wann ein Währungssicherungsgeschäft zurückgenommen werden soll und der Gewinn oder Verlust aus diesem Sicherungsgeschäft unter Berücksichtigung der Häufigkeit und der damit verbundenen Transaktions- und Reinvestitionskosten für das Zurücksetzen des Währungssicherungsgeschäfts wieder angelegt oder abgerechnet werden soll.

3.2.2 Aus dem Zinsrisiko entstehendes Marktrisiko

Das Zinsrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert künftiger Cashflows eines Finanzinstruments aufgrund von Wertänderungen der Marktzinsen schwankt.

Bestehendes Zinsrisiko

Jeder Fonds ist durch seine Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, einschließlich der bei Maklern gehaltenen Barsicherheiten, die Nutzung von Kreditfazilitäten sowie durch seine Anlagen in verzinslichen Finanzinstrumenten, die in den Aufstellungen der Vermögenswerte angegeben sind, einem Zinsrisiko ausgesetzt.

Jeder Fonds ist außerdem auch indirekt durch seine Anlagen in Investmentfonds (CIS), ETF und Zins-DFI einem Zinsrisiko ausgesetzt, da der Wert eines zugrunde liegenden Vermögenswerts infolge von Veränderungen der Zinssätze schwanken kann.

Steuerung des Zinsrisikos

Das Zinsrisiko wird durch die ständige Beobachtung der Positionen in Bezug auf Veränderungen, die sich außerhalb eines festgelegten Toleranzbereichs bewegen, und, sofern erforderlich, durch Neuausrichtung auf die ursprünglich gewünschten Parameter verwaltet.

Zahlungsmittel werden in Geldmarktfonds investiert, um eine Rendite zu erzielen, die den Fonds vor ungünstigen Zinsbewegungen schützt.

3.2.3 Aus dem Preisrisiko entstehendes Marktrisiko

Das Preisrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder künftige Cashflows eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktpreise (außer solchen, die sich aus Zins- oder Währungsrisiken ergeben) schwanken, wobei diese Veränderungen durch spezifische Faktoren des einzelnen Finanzinstruments oder seines Emittenten bedingt sein können oder durch Faktoren, welche ähnliche, am Markt gehandelte Instrumente beeinflussen. Lokale, regionale oder globale Ereignisse wie Krieg, Terrorakte, die Ausbreitung von Infektionskrankheiten oder andere Probleme im Bereich der öffentlichen Gesundheit wie z. B. die COVID-19-Pandemie, Rezessionen, der Klima oder sonstige Ereignisse könnten erhebliche Auswirkungen auf jeden Fonds und die Marktpreise seiner Anlagen haben.

Bestehendes Preisrisiko

Jeder Fonds ist einem Preisrisiko ausgesetzt, das sich aus der Anlage in Finanzinstrumenten ergibt. Das Preisrisiko jedes Fonds besteht im beizulegenden Zeitwert der gehaltenen Anlagen wie in den Aufstellungen der Vermögenswerte jedes Fonds ausgewiesen.

Steuerung des Preisrisikos

Durch Diversifizierung des Portfolios wird, falls dies den Zielen des jeweiligen Fonds entspricht und mit diesen konsistent ist, das Risiko, dass eine Preisänderung einer bestimmten Anlage wesentliche Auswirkungen auf den NIW des jeweiligen Fonds hat, minimiert.

Es besteht ein Risiko, dass die Bewertung der einzelnen Fonds den Wert der Anlagen, die sie halten, aus Gründen, die außerhalb der Kontrolle des Verwaltungsrats liegen, zu einem bestimmten Zeitpunkt nicht zutreffend widerspiegelt, was zu wesentlichen Verlusten oder einer falschen Preisstellung für die einzelnen Fonds führen könnte. Um dieses Risiko zu mindern, kann der Verwaltungsrat vorübergehend die Bestimmung des NIW eines Fonds aussetzen, bis eine faire oder angemessene Bewertung der Anlagen ermittelt werden kann.

Das Preisrisiko, das mit Positionen in Investmentfonds (CIS) verbunden ist, wird vom Investmentmanager überwacht, indem die Anlageziele der zugrunde liegenden Fonds sowie deren interne Kontrollrichtlinien und regelmäßigen Risiko- und Performanceberichte geprüft werden. Bei allen Anlagen in anderen CIS handelt es sich um Anlagen in Fonds nahestehender Parteien. Diese CIS unterliegen denselben Kontrollverfahren, die der Investmentmanager für jeden Fonds anwendet.

3.3 Liquiditätsrisiko

Das Liquiditätsrisiko ist das Risiko, dass der jeweilige Fonds Schwierigkeiten bekommt, Verpflichtungen im Zusammenhang mit finanziellen Verbindlichkeiten nachzukommen.

Bestehendes Liquiditätsrisiko

Die wesentlichen Liquiditätsrisiken jedes Fonds ergeben sich zum einen daraus, dass die Anleger Rücknahmeanträge stellen können, und zum anderen aus der Liquidität der zugrunde liegenden Anlagen, in die der jeweilige Fonds investiert hat.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.3 Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Bestehende Liquiditätsrisiken (Fortsetzung)

Die Anteilinhaber jedes Fonds können ihre Anteile am Ende jedes täglichen Handelstermins gegen eine Barzahlung in Höhe eines proportionalen Anteils am Nettoinventarwert der einzelnen Fonds, unter Ausschluss der ggf. anwendbaren Abgaben und Gebühren, zurückgeben. Jeder Fonds ist daher potenziell dem Liquiditätsrisiko ausgesetzt, die Rücknahmeaufträge der Anteilinhaber erfüllen zu müssen, und ist möglicherweise gezwungen, Vermögenswerte zu aktuellen Börsenkursen zu verkaufen, um den Liquiditätsbedarf zu decken.

Jeder Fonds kann in Investmentfonds (CIS) anlegen, die in Bezug auf Rücknahmen Fristen oder andere Beschränkungen auferlegen können, wodurch sich das Liquiditätsrisiko des jeweiligen Fonds erhöhen kann. Jeder Fonds ist auch einem Liquiditätsrisiko durch tägliche Nachschussforderungen für DFI ausgesetzt.

Sämtliche finanziellen Verbindlichkeiten des Fonds sind auf der Grundlage vertraglicher Fälligkeiten innerhalb von drei Monaten fällig. Die erwarteten Abrechnungstermine können, basierend auf der Analyse der Restlaufzeit zum Bilanzstichtag bis zum Fälligkeitstermin, mehr als drei Monate betragen und sind in der Aufstellung der Vermögenswerte aufgeführt.

Steuerung des Liquiditätsrisikos

Das Liquiditätsrisiko wird dadurch minimiert, dass ausreichend liquide Anlagen gehalten werden, die veräußert werden können, um Liquiditätsanforderungen erfüllen zu können. Es können auch Veräußerungen von Vermögenswerten erforderlich sein, um Rücknahmeanträge zu erfüllen. Ein zeitnahe Verkauf von Handelspositionen kann jedoch durch viele Faktoren beeinträchtigt werden, unter anderem durch das Handelsvolumen und eine erhöhte Kursvolatilität. Infolgedessen kann jeder Fonds bei der Veräußerung von Vermögenswerten zur Befriedigung von Liquiditätsbedarf Probleme bekommen.

Das Liquiditätsrisiko jedes Fonds wird durch den Investmentmanager gemäß den geltenden Richtlinien und Verfahren gemanagt. Die Portfoliomanager prüfen täglich die Liquiditätsberichte, in denen Prognosen über den Liquiditätsbedarf gestellt werden. Diese Berichte ermöglichen ihnen das Management ihres Liquiditätsbedarfs. Wenn Rücknahmeanträge von allen Anteilinhabern eines Fonds an einem bestimmten Handelstag 10 % des NIW des einzelnen Fonds übersteigen, ist der Verwaltungsrat befugt, nach eigenem Ermessen die Rücknahme der dieses Limit übersteigenden Anzahl ausgegebener Anteile des Fonds zu verweigern. Die Anteile, die an einem Handelstag nicht zurückgenommen werden, werden an jedem folgenden Handelstag anteilig, vorrangig vor später eingegangenen Anträgen zurückgenommen.

Keiner der Vermögenswerte der Fonds unterliegt speziellen Liquiditätsvereinbarungen.

Die Verwaltungsgesellschaft kann die Ermittlung des NIW eines Fonds und die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen einer Klasse eines Fonds während des gesamten oder eines Teils eines Berichtszeitraums vorübergehend aussetzen:

(i) wenn einer der Hauptmärkte, an denen ein wesentlicher Teil der Anlagen des betreffenden Fonds von Zeit zu Zeit notiert oder gehandelt wird, geschlossen ist (außer wegen üblicher Wochenenden oder gewöhnlicher Feiertage) oder der Handel dort eingeschränkt oder ausgesetzt ist oder der Handel an einer relevanten Terminbörse oder einem Markt eingeschränkt oder ausgesetzt ist;

(ii) wenn infolge politischer, wirtschaftlicher, militärischer oder monetärer Ereignisse oder sonstiger Umstände, die außerhalb der Kontrolle, Verantwortung und Macht der Verwaltungsgesellschaft liegen, eine Veräußerung oder Bewertung von Anlagen des betreffenden Fonds nach Ansicht der Verwaltungsgesellschaft nicht angemessen durchführbar ist, ohne dass dies den Interessen der Eigentümer von Anteilen im Allgemeinen oder der Eigentümer von Anteilen des betreffenden Fonds ernsthaft schadet, oder wenn nach Ansicht der Verwaltungsgesellschaft der Rücknahmepreis nicht fair berechnet werden kann oder eine solche Veräußerung den Eigentümern von Anteilen im Allgemeinen oder den Eigentümern von Anteilen des betreffenden Fonds wesentlich schaden würde;

(iii) wenn während eines Ausfalls der Kommunikationsmittel, die normalerweise für die Ermittlung des Wertes der Anlagen des Fonds verwendet werden, oder wenn der Wert der Anlagen oder anderer Vermögenswerte des betreffenden Fonds aus einem anderen Grund nicht angemessen oder fair ermittelt werden können;

(iv) wenn die Verwaltungsgesellschaft nicht in der Lage ist, Gelder zum Zwecke von Rücknahmezahlungen zurückzuführen, oder wenn solche Zahlungen nach Ansicht der Verwaltungsgesellschaft nicht zu normalen Preisen oder normalen Wechselkursen durchgeführt werden können, oder während derer ein Transfer von Geldern, die mit der Realisierung oder dem Erwerb von Anlagen verbunden sind, oder wenn fällige Zahlungen oder Rücknahmen nicht zu normalen Preisen oder normalen Wechselkursen durchgeführt werden können; oder

(v) nach Zustellung einer Mitteilung über eine Versammlung der Anteilinhaber, auf der ein Beschluss zur Auflösung des Fonds vorgeschlagen werden soll oder ein Beschluss zur Auflösung des Fonds gefasst wurde.

3.4 Kontrahentenausfallrisiko

Das Kontrahentenausfallrisiko ist das Risiko, dass eine Partei eines Finanzinstruments der anderen Partei durch die Nichterfüllung einer Verpflichtung einen finanziellen Verlust verursacht.

Bestehendes Kontrahentenausfallrisiko

Jeder Fonds ist einem Kontrahentenausfallrisiko in Bezug auf die Parteien ausgesetzt, mit denen er handelt, und trägt das Abwicklungsrisiko.

Die Anfälligkeit jedes Fonds ist auf die Kontrakte beschränkt, bei denen er gerade eine Position in finanziellen Vermögenswerten hat, verringert um von dem Kontrahenten erhaltene Sicherheiten, beziehungsweise auf Kontrahenten, die Sicherheiten aus dem Fonds erhalten haben. Der Buchwert der finanziellen Vermögenswerte spiegelt zusammen mit den von den Kontrahenten gehaltenen Zahlungsmitteln am besten das maximale Bruttoreisiko jedes Fonds im Zusammenhang mit dem Kontrahentenausfallrisiko zum Berichtsdatum wider, ohne Aufnahme der Auswirkungen aus dem ISDA-Rahmenvertrag („International Swaps and Derivatives Association“), und der Netting-Vereinbarungen, die das gesamte Kontrahentenausfallrisiko senken würden. Jeder Fonds schließt nur mit Kontrahenten Geschäfte ab, die regulierte und sorgfältig überwachte Unternehmen sind oder hohe Bonitätsratings von internationalen Ratingagenturen haben. Als Sicherheit von dem Kontrahenten von DFI gehaltene Zahlungsmittel unterliegen dem Kontrahentenausfallrisiko.

Alle Transaktionen in börsennotierten Wertpapieren werden durch zugelassene Makler abgewickelt/bezahlt. Das Risiko im Zusammenhang mit noch nicht abgerechneten Transaktionen wird aufgrund der kurzen Abrechnungsfristen und der hohen Bonität der eingesetzten Makler als gering betrachtet.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

Steuerung des Kontrahentenausfallrisikos

Das Kontrahentenausfallrisiko wird durch das RQA Counterparty & Concentration Risk Team von BlackRock überwacht und gesteuert. Die Leitung des Teams hat BlackRocks Chief Counterparty Credit Officer, der dem Global Head of RQA berichtet. Die Kreditkompetenz liegt beim Chief Counterparty Credit Officer und ausgewählten Team-Mitgliedern, an die bestimmte Kreditkompetenzen delegiert wurden. Dadurch können nach Bedarf Kontrahenten durch den Chief Counterparty Credit Officer oder durch festgelegte RQA Credit Risk Officers genehmigt werden, denen die Kompetenz formell vom Chief Counterparty Credit Officer übertragen wurde.

Das BlackRock RQA Counterparty Risk Team unterzieht jeden neuen Kontrahenten einer formellen Überprüfung, überwacht und prüft laufend alle genehmigten Kontrahenten und behält die aktive Kontrolle über die Engagements und die Prozesse der Sicherheitenverwaltung.

Zum 31. März 2024 und 31. März 2023 bestanden keine überfälligen oder wertgeminderten Salden im Zusammenhang mit Transaktionen mit Kontrahenten.

3.4.1 DFI

Die Beteiligungen jedes Fonds an börsengehandelten und OTC-DFI setzen den Fonds einem Kontrahentenausfallrisiko aus.

3.4.1.1 Börsengehandelte DFI

Das Risiko ist durch den Handel mit Kontrakten über ein Clearinghaus begrenzt. Das Kreditrisiko jedes Fonds aus Kontrakten, bei denen er derzeit eine Gewinnposition hat, reduziert sich um die vom Kontrahenten als liquide Mittel erhaltenen Gewinne aus dem täglichen Neubewertungsmechanismus bei börsengehandelten Kontrakten (Variation-Marge). Das Kreditrisiko jedes Fonds aus Kontrakten, bei denen er derzeit eine Verlustposition hat, entspricht dem Betrag der vom Kontrahenten gestellten Sicherheitsleistung, die nicht im Rahmen des täglichen Neubewertungsmechanismus an die Börse übertragen wurde.

3.4.1.2 OTC-DFI

Das Risiko im Zusammenhang mit OTC-DFI entsteht dadurch, dass der Kontrahent nicht entsprechend den Bestimmungen des Kontrakts seine Pflichten erfüllt, da solche DFI-Transaktionen bilateral erfolgen und nicht durch einen zentralen Clearing-Kontrahenten.

Sämtliche OTC-DFI-Transaktionen werden von jedem Fonds als Teil eines ISDA-Rahmenvertrags oder einer ähnlichen Vereinbarung abgeschlossen. Ein ISDA-Rahmenvertrag ist eine bilaterale Vereinbarung zwischen den einzelnen Fonds und einem Kontrahenten, der die von den Parteien abgeschlossenen OTC-DFI-Transaktionen regelt.

Das Engagement der Parteien gemäß dem ISDA-Rahmenvertrag wird verrechnet und zusammen besichert. Daher erfolgen alle Offenlegungen zu Sicherheiten in Bezug auf alle OTC-DFI-Transaktionen, welche die einzelnen Fonds gemäß dem ISDA-Rahmenvertrag abgeschlossen haben. Alle bar hinterlegten Sicherheiten, die die einzelnen Fonds laut dem ISDA-Rahmenvertrag erhalten/leisten, werden bilateral gemäß einem Titelabtretungsvertrag übertragen.

Jeder Fonds ist rechtlicher Eigentümer der eingehenden Sicherheitsleistungen und kann die Vermögenswerte bei Ausfall verkaufen und die Zahlungsmittel einbehalten. Wenn der Kontrahent seine Verpflichtungen im Zusammenhang mit der Anlage erfüllt, zahlt jeder Fonds einen gleichwertigen Barbetrag bei Fälligkeit oder dem Verkauf einer Anlage an den Kontrahenten zurück. Wenn ein Fonds Wertpapiersicherheiten an den Kontrahenten zurückgibt, müssen diese von der gleichen Art sein und den gleichen Nennwert, die gleiche Beschreibung und den gleichen Betrag der Wertpapiere haben, die auf den jeweiligen Fonds übertragen wurden. Durch Transaktionen mit OTC-DFI, für die keine Sicherheiten gestellt wurden, entstehen Kontrahentenrisiken.

Das maximale Kontrahentenausfallrisiko der einzelnen Fonds aus Beständen in Devisenterminkontrakten entspricht dem Nennwert des Währungskontrakts und nicht realisierten Nettogewinnen des entsprechenden Fonds, wie in den Aufstellungen der Vermögenswerte angegeben.

Mit Ausnahme der nicht lieferfähigen Devisenterminkontrakte, die vom BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Fund gehalten werden, erfordern Devisenterminkontrakte keine Variation-Margen, und daher wird das Kontrahentenausfallrisiko über das BlackRock RQA Counterparty Risk Team überwacht, das die Bonität des Kontrahenten kontrolliert. Sicherheitsleistungen für nicht lieferfähige Devisenterminkontrakte werden wechselseitig gestellt, um Risiken abzudecken, die der Kontrahent oder die einzelnen Fonds füreinander darstellen. Das „Margin-Cashkonto“ in der Bilanz setzt sich zusammen aus Sicherheitsleistungen, die von den Clearing-Brokern und Kontrahenten für Devisenterminkontrakte des Fonds zu vereinnahmen sind.

Jeder Fonds ist berechtigt, erhaltene Barsicherheiten zu reinvestieren. Vom jeweiligen Fonds verpfändete Barsicherheiten werden in den Bilanzen gesondert als Barsicherheiten ausgewiesen und werden nicht als Komponente der Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente berücksichtigt. Dem jeweiligen Fonds zur Verfügung gestellte Barsicherheiten werden in den Bilanzen als Verbindlichkeiten aus Barsicherheiten ausgewiesen. Jeder Fonds ist auch durch die Weiterverpfändung verpfändeter Sicherheiten einem Kontrahentenrisiko ausgesetzt. Der Wert eingehender Barsicherheiten und verpfändeter Barsicherheiten geht aus den Bilanzen der jeweiligen Fonds hervor.

In den nachstehenden Tabellen ist gegebenenfalls die Gesamtzahl der OTC-DFI-Kontrahenten aufgeführt, deren Risiko die Fonds unterliegen, das niedrigste langfristige Bonitätsrating eines einzelnen Kontrahenten (bzw. seiner übergeordneten Muttergesellschaft, wenn der Kontrahent kein Rating hat), das maximale Risiko gegenüber einem einzelnen Kontrahenten (das auf Nettobasis berechnet wird) sowie die im Zusammenhang mit dem Risiko gegenüber dem betreffenden Kontrahenten erhaltenen Gesamtbar- und Sachsicherheiten:

Zum 31. März 2024	Währung	Gesamtzahl der Kontrahenten	Niedrigstes Bonitätsrating eines einzelnen Kontrahenten	Höchstes Risiko gegenüber einem einzelnen Kontrahenten Tsd.	Im Zusammenhang mit dem maximalen Risiko erhaltene Gesamtsicherheiten Tsd.
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	1	A+	–	–
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	3	A+	27	–
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	EUR	4	A	1	–
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	EUR	3	A	–	–
FR Multi-Asset Fund	EUR	7	A-	1	–

NM0724U-3752176-45/238

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

3.4.1 DFI (Fortsetzung)

3.4.1.2 OTC-DFI (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024	Währung	Gesamtzahl der Kontrahenten	Niedrigstes Bonitätsrating eines einzelnen Kontrahenten	Höchstrisiko gegenüber einem einzelnen Kontrahenten Tsd.	Im Zusammenhang mit dem maximalen Risiko erhaltene Gesamtsicherheiten Tsd.
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	EUR	1	A+	45	–

Zum 31. März 2023	Währung	Gesamtzahl der Kontrahenten	Niedrigstes Bonitätsrating eines einzelnen Kontrahenten	Höchstrisiko gegenüber einem einzelnen Kontrahenten Tsd.	Im Zusammenhang mit dem maximalen Risiko erhaltene Gesamtsicherheiten Tsd.
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	1	A+	–	–
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	EUR	14	A-	603	–
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	3	A+	34	–
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	EUR	1	A+	99	–
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	EUR	4	A	400	–
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	3	A+	15	18
FR Multi-Asset Fund	EUR	11	A-	975	–

Bei Total Return Swaps, die vom BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund gehalten werden, ist das Risiko weiter dadurch gemindert, dass die Bewegungen von Zahlungsmitteln auf monatlicher Basis stattfinden und der Gewinn oder Verlust im betreffenden Fonds realisiert wird.

3.4.2 Treuhänder

Der überwiegende Teil der Anlagen wird zum Ende des Geschäftsjahres vom Treuhänder gehalten. Die Anlagen sind vom Vermögen des Treuhänders getrennt, wobei die Eigentumsrechte beim jeweiligen Fonds verbleiben. Im Falle eines Konkurses oder einer Insolvenz des Treuhänders könnte es zu Verzögerungen oder Einschränkungen der Rechte der Fonds im Hinblick auf ihre Anlagen, die vom Treuhänder gehalten werden, kommen. Das maximale diesbezügliche Risiko entspricht der Höhe der in der Aufstellung der Vermögenswerte angegebenen Long-Investments zuzüglich nicht abgewickelter Geschäfte.

Im Wesentlichen alle Barmittel des jeweiligen Fonds werden von JPMorgan Chase Bank NA (Niederlassung London), dem verbundenen Unternehmen des Treuhänders, auf dessen Konten gehalten, zusammen mit deren eigenen Barsalden und den Barsalden, die für andere Kunden gehalten werden.

In Bezug auf die vom verbundenen Unternehmen des Treuhänders gehaltenen Barmittel sind die einzelnen Fonds dem Kontrahentenausfallrisiko des verbundenen Unternehmens des Treuhänders ausgesetzt. Bei Insolvenz oder Konkurs des verbundenen Unternehmens des Treuhänders werden die einzelnen Fonds als nicht bevorrechtigte Gläubiger des verbundenen Unternehmens des Treuhänders behandelt.

Um das Risiko jedes Fonds gegenüber dem Treuhänder zu mindern, wendet der Investmentmanager besondere Verfahren an, mit denen sichergestellt werden soll, dass der Treuhänder ein angesehenes Institut und das Kontrahentenausfallrisiko für jeden Fonds tragbar ist. Jeder Fonds schließt nur mit Treuhändern Geschäfte ab, die regulierte und sorgfältig überwachte Unternehmen sind oder hohe Bonitätsratings von internationalen Ratingagenturen haben.

Das langfristige Rating der Muttergesellschaft des Treuhänders zum 31. März 2024 beträgt A+ (31. März 2023: A+) (Standard & Poor's Rating).

Um das Kontrahentenausfallrisiko der einzelnen Fonds gegenüber dem verbundenen Unternehmen des Treuhänders zu verringern, kann jeder Fonds zusätzliche Vereinbarungen treffen, beispielsweise über die Platzierung von Barreserven in einem Geldmarktfonds.

3.4.3 Wertpapierleihe

Jeder Fonds, der Wertpapierleihgeschäfte tätigt, ist dadurch einem Kontrahentenausfallrisiko ausgesetzt. Das maximale Risiko jedes Fonds entspricht dem Wert der verliehenen Wertpapiere.

Alle Wertpapierleihgeschäfte, die von den Fonds eingegangen werden, unterliegen einer schriftlichen Vereinbarung zwischen dem jeweiligen Fonds und dem Vermittler für Wertpapierleihen, BlackRock Advisors (UK) Limited, einer mit dem Unternehmen verbundenen Partei, und getrennt zwischen dem Vermittler für Wertpapierleihen und dem genehmigten Entleiher. Sicherheiten, die im Austausch für verliehene Wertpapiere entgegengenommen werden, werden gemäß einem Titelabtretungsvertrag im Namen des Treuhänders im Auftrag des jeweiligen Fonds an einen dritten Sicherheitenverwalter geliefert und auf dessen Konto gehalten. Die geleisteten Sicherheiten werden von den Vermögenswerten getrennt, die dem Treuhänder des jeweiligen Fonds oder dem Vermittler für Wertpapierleihen gehören.

Die Sicherheiten werden auf den Namen des Treuhänders für den jeweiligen Fonds bei einem oder allen der folgenden zentralen Wertpapierverwahrungsstellen registriert und hinterlegt: JP Morgan Chase, Euroclear oder Bank of New York Mellon, je nach Art der Sicherheit, die der Kontrahent zur Deckung des erforderlichen Risikowerts zur Verfügung gestellt hat. Die von diesen Kontrahenten gestellten Sicherheiten setzen sich zusammen aus an einem geregelten Markt zum Handel zugelassenen Aktien.

Die nachfolgend dargestellten Fonds tätigten im Laufe des Geschäftsjahres Wertpapierleihgeschäfte. Der Wert der zum Ende des Geschäftsjahres verliehenen Wertpapiere und gehaltenen Sicherheiten ist nachstehend angegeben:

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzrisiko (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

3.4.3 Wertpapierleihe (Fortsetzung)

Name des Fonds	Währung	Wert der verliehenen Wertpapiere	Wert der erhaltenen Sicherheiten	Wert der verliehenen Wertpapiere	Wert der erhaltenen Sicherheiten
		31. März 2024 Tsd.	Tsd.	31. März 2023 Tsd.	Tsd.
BlackRock UK Credit Screened Fund	GBP	–	–	4.212	4.551
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	9.134	9.873	4.372	4.830
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	EUR	–	–	11.427	12.163
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	EUR	8.931	10.921	8.639	9.577
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	2.614	2.850	2.867	3.738
BlackRock Global Equity Selection Fund	EUR	309	375	–	–
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	EUR	562	665	–	–
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	EUR	2.895	3.124	–	–
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	–	–	135	148
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	EUR	902	937	–	–

Zur Verminderung dieses Risikos erhält jeder Fonds entweder Barsicherheiten oder Wertpapiere als Sicherheiten, die einem bestimmten Prozentsatz des Werts der verliehenen Wertpapiere entsprechen. Der Investmentmanager überwacht den beizulegenden Zeitwert der verliehenen Wertpapiere und fordert gegebenenfalls zusätzliche Sicherheiten an.

Zum 31. März 2024 und 31. März 2023 bestehen alle erhaltenen Sicherheiten aus Wertpapieren, die an einem geregelten Markt zugelassen sind oder gehandelt werden.

Jeder Fonds ist Begünstigter einer Ausfallbürgschaft für Entleiher durch die BlackRock Inc. Die Ausfallbürgschaft erlaubt den vollständigen Ersatz der verliehenen Wertpapiere. BlackRock Inc. trägt die Kosten der Ausfallbürgschaften für Entleiher.

3.4.4 Emittentenausfallrisiko in Bezug auf Schuldinstrumente

Das Emittentenausfallrisiko ist das Risiko, dass einer der Emittenten der von einem Fonds gehaltenen Schuldinstrumente ausfällt. Schuldinstrumente sind mit einem Kreditrisiko gegenüber dem Emittenten verbunden, das aus dem Bonitätsrating des Emittenten ersichtlich ist. Wertpapiere, die nachrangig sind und/oder ein niedrigeres Bonitätsrating haben, gelten generell als mit einem höheren Kreditrisiko und einer höheren Ausfallwahrscheinlichkeit behaftet als solche mit höheren Ratings. Der Fonds investiert in Staats- und Unternehmensanleihen, was ihn dem Ausfallrisiko des Emittenten in Hinblick auf Zins- oder Kapitalzahlungen aussetzt.

In den folgenden Tabellen ist das Bonitätsrating-Profil der von den einzelnen Fonds gehaltenen Schuldinstrumente aufgeführt:

Zum 31. März 2024	Währung	Schuldinstrumente, Anteil Investment-Grade in %	Schuldinstrumente, Anteil Non-Investment-Grade in %	Schuldinstrumente, Anteil Titel ohne Rating in %	Schuldinstrumente, Anteil Gesamtanteil in %
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	EUR	99,50	0,50	–	100,00
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	70,82	29,18	–	100,00
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	100,00	–	–	100,00
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	EUR	93,17	6,83	–	100,00

Zum 31. März 2023	Währung	Schuldinstrumente, Anteil Investment-Grade in %	Schuldinstrumente, Anteil Non-Investment-Grade in %	Schuldinstrumente, Anteil Titel ohne Rating in %	Schuldinstrumente, Anteil Gesamtanteil in %
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	EUR	98,92	1,08	–	100,00
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock UK Credit Screened Fund	GBP	97,97	2,03	–	100,00
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	67,37	32,27	0,36	100,00
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	100,00	–	–	100,00
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	100,00	–	–	100,00

Zur Steuerung dieses Risikos investiert der Investmentmanager im Rahmen der Ziele des jeweiligen Fonds in eine breite Palette von Schuldinstrumenten. Die Ratings der Schuldtitel werden kontinuierlich durch die BlackRock Portfolio Management Group („PMG“) überwacht. Für Wertpapiere ohne Rating, nachrangige Wertpapiere oder solche mit niedrigerem Bonitätsrating kommen außerdem besondere Verfahren zur Anwendung, um sicherzustellen, dass das damit verbundene Kreditrisiko für jeden Fonds tragbar ist.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie

Jeder Fonds klassifiziert seine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Finanzinstrumente anhand einer Zeitwerthierarchie. Die Zeitwerthierarchie hat die folgenden Kategorien:

Ebene 1: Der nicht angepasste notierte Preis in einem aktiven Markt für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, auf den das Unternehmen zum Bewertungstag zugreifen kann.

Ebene 2: Andere Parameter als die in Ebene 1 enthaltenen notierten Preise, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit direkt oder indirekt beobachtbar sind (d. h. anhand von Marktdaten entwickelt wurden). Diese Kategorie beinhaltet Instrumente, die bewertet werden anhand von: auf aktiven Märkten für ähnliche Instrumente notierten Preisen; notierten Preisen für ähnliche Instrumente auf Märkten, die als weniger als aktiv betrachtet werden; oder anderen Bewertungstechniken, bei denen alle maßgeblichen Parameter direkt oder indirekt aus Marktdaten beobachtbar sind.

Ebene 3: Die Parameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit sind nicht beobachtbar (d. h. für sie sind keine Marktdaten verfügbar). Diese Kategorie beinhaltet alle Instrumente, bei denen die eingesetzten Bewertungstechniken Parameter berücksichtigen, die nicht auf Marktdaten basieren, und diese Parameter könnten einen maßgeblichen Einfluss auf die Bewertung des Instruments haben. Diese Kategorie beinhaltet auch Instrumente, die anhand von notierten Preisen ähnlicher Instrumente bewertet werden, wobei maßgebliche, von einem Vertragspartner festgelegte Anpassungen oder Annahmen erforderlich sind, um die Unterschiede zwischen den Instrumenten zu berücksichtigen, sowie Instrumente, für die kein aktiver Markt besteht.

Zu den spezifischen Bewertungstechniken, die zur Bewertung von Finanzinstrumenten der Ebene 2 und/oder Ebene 3 verwendet wurden, gehören:

- (i) für Schuld- und Aktieninstrumente die Verwendung von notierten Marktpreisen oder Händlernotierungen für ähnliche Instrumente;
- (ii) für Anlagen, bei denen es sich um einen Beteiligungsanteil an einem Investmentfonds („CIS“) und Investitionen in börsengehandelte Indexfonds („ETFs“) handelt, wenn der Fonds die von ihm gehaltenen Anteile in der Regel zum letzten NIW für diesen ETF handelt, die Bewertung zum ungeprüften NIW bzw., wenn verfügbar, zum unabhängig geprüften NIW, am Bewertungstag dieses Beteiligungsanteils anhand der Berechnung durch den Verwalter des Beteiligungsanteils des CIS und gemäß den Anforderungen des Organismus, an dem die betreffende Anlage einen Anteil oder eine Beteiligung darstellt. Der ungeprüfte NIW des zugrunde liegenden Beteiligungsanteils an einem CIS und ETF wird vor Abzug von Rücknahmekosten ausgewiesen, die gegebenenfalls bei einer Rückgabe an diesen zugrunde liegenden CIS und ETF anfallen können. Der ungeprüfte NIW des zugrunde liegenden CIS und ETF, in den investiert wird, kann bei Ausgabe seines jeweiligen unabhängig geprüften Jahresabschlusses Berichtigungen unterliegen, und solche Berichtigungen können für den Abschluss des Fonds wesentlich sein;
- (iii) für ausländische Aktien die Verwendung unabhängiger Zeitwert-Adjustierungsfaktoren, um die Differenz zwischen dem letzten Marktschluss und dem Bewertungszeitpunkt des Fonds widerzuspiegeln;
- (iv) für notleidende Schuldtitel die Verwendung jüngster Transaktionen und notleidender Aktieninstrumente, für die keine Marktdaten verfügbar sind;
- (v) für Zinsswaps der Barwert der geschätzten künftigen Cashflows auf der Grundlage beobachtbarer Renditekurven;
- (vi) bei Total Return Swaps der Wert der geschätzten Cashflows auf der Grundlage des Marktwertes der zugrunde liegenden Referenzanlage bzw. des zugrunde liegenden Benchmarkindex am Bilanzstichtag;
- (vii) für Inflationsswaps der Barwert der geschätzten künftigen Cashflows auf der Grundlage beobachtbarer Renditekurven. Für den Fall, dass das Modell und die Parameter nicht am Markt beobachtbar sind, können bestimmte Nullkupon-Inflationsswaps anhand eines einzigen Kurses des Swap-Kontrahenten bewertet werden.
- (viii) bei Devisentermingeschäften der Barwert zukünftiger Cashflows auf der Grundlage der Devisenterminkurse am Bilanzstichtag;
- (ix) für Zusagen im Zusammenhang mit SPAC/PIPE (Special Purpose Acquisition Company, Private Investment in Public Equity) die Verwendung der zugrunde liegenden notierten Marktpreise und die Anwendung von Abschlägen für mangelnde Marktfähigkeit, Volatilität und Handelsabschlusswahrscheinlichkeit;
- (x) für Fremdwährungsoptionen, Optionspreismodelle; und
- (xi) für andere Finanzinstrumente: Discounted-Cashflow-Analysen.

Die Ebene in der Zeitwerthierarchie, der die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit zugeordnet wird, wird anhand des niedrigsten Bewertungsparameters festgelegt, der für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit maßgeblich ist. Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit eines Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Werden bei einer Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter verwendet, die aufgrund von nicht beobachtbaren Parametern eine maßgebliche Anpassung erfordern, so ist diese Zeitwertbewertung der Ebene 3 zuzuordnen. Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

Die Entscheidung, welche Parameter als „beobachtbar“ gelten, erfordert ein beträchtliches Urteilsvermögen. Für den Verwaltungsrat gelten als beobachtbare Parameter solche Marktdaten, die jederzeit verfügbar sind, regelmäßig veröffentlicht oder aktualisiert werden, verlässlich und überprüfbar und nicht geschützt sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt wurden, die aktiv mit dem betreffenden Markt beschäftigt sind.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

Die folgenden Tabellen zeigen eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds zum 31. März 2024 und 31. März 2023:

31. März 2024	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	57.548	–	57.548
Börsengehandelte Fonds	–	131.371	–	131.371
Gesamt	–	188.919	–	188.919
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	707.639	–	707.639
Gesamt	–	707.639	–	707.639
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	73.047	–	73.047
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	5	–	5
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten (Futures)	21	–	–	21
Gesamt	21	73.052	–	73.073
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(123)	–	(123)
Gesamt	–	(123)	–	(123)
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	37.206	–	37.206
Börsengehandelte Fonds	28.435	–	–	28.435
Gesamt	28.435	37.206	–	65.641
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Aktien	237.334	–	–	237.334
Anleihen	–	28.999	–	28.999
Nicht realisierte Gewinne aus Swaps	–	235	–	235
Gesamt	237.334	29.234	–	266.568
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Swaps	–	(655)	–	(655)
Nicht realisierte Verluste aus Terminkontrakten (Futures)	(26)	–	–	(26)
Gesamt	(26)	(655)	–	(681)
BlackRock Global Equity Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	20.708	–	20.708
Börsengehandelte Fonds	10.109	–	–	10.109
Gesamt	10.109	20.708	–	30.817
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	21.200	–	21.199
Börsengehandelte Fonds	10.179	–	–	10.179
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	1	–	1
Gesamt	10.179	21.201	–	31.379
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(23)	–	(23)
Gesamt	–	(23)	–	(23)
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	41.786	–	41.786
Börsengehandelte Fonds	36.170	–	–	36.170
Börsengehandelte Rohstoffe	820	–	–	820
Gesamt	36.990	41.786	–	78.776
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(71)	–	(71)
Gesamt	–	(71)	–	(71)
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund¹	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Aktien	56	–	–	56
Gesamt	56	–	–	56

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

31. März 2024 (Fortsetzung)	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
FR Multi-Asset Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	170.451	–	170.451
Börsengehandelte Fonds	126.836	–	–	126.836
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	1.779	–	1.779
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten (Futures)	304	–	–	304
Gesamt	127.140	172.230	–	299.370
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(8.268)	–	(8.268)
Nicht realisierte Verluste aus Terminkontrakten (Futures)	(308)	–	–	(308)
Gesamt	(308)	(8.268)	–	(8.576)
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	223.276	–	223.276
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	56	–	56
Gesamt	–	223.332	–	223.332
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(11)	–	(11)
Gesamt	–	(11)	–	(11)
¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.				
31. März 2023	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	46.687	–	46.687
Börsengehandelte Fonds	–	100.460	–	100.460
Gesamt	–	147.147	–	147.147
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	495.908	–	495.908
Gesamt	–	495.908	–	495.908
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Terminkontrakten (Futures)	(122)	–	–	(122)
Gesamt	(122)	–	–	(122)
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	79.517	–	79.517
Gesamt	–	79.517	–	79.517
BlackRock UK Credit Screened Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	122.365	–	122.365
Gesamt	–	122.365	–	122.365
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	81.346	–	81.346
Gesamt	–	81.346	–	81.346
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(125)	–	(125)
Gesamt	–	(125)	–	(125)
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	94.880	–	94.880
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	1.389	–	1.389
Gesamt	–	96.269	–	96.269
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(679)	–	(679)
Gesamt	–	(679)	–	(679)
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	37.383	–	37.383
Börsengehandelte Fonds	–	29.116	–	29.116
Gesamt	–	66.499	–	66.499

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

31. März 2023	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Aktien	223.261	–	–	223.261
Anleihen	–	19.131	–	19.131
Nicht realisierte Gewinne aus Swaps	–	349	–	349
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten (Futures)	208	–	–	208
Gesamt	223.469	19.480	–	242.949
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Swaps	–	(475)	–	(475)
Gesamt	–	(475)	–	(475)
BlackRock Global Equity Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	20.300	–	20.300
Börsengehandelte Fonds	9.454	–	–	9.454
Gesamt	9.454	20.300	–	29.754
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	23.297	–	23.297
Börsengehandelte Fonds	11.798	–	–	11.798
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	99	–	99
Gesamt	11.798	23.396	–	35.194
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	49.456	–	49.456
Börsengehandelte Fonds	38.623	–	–	38.623
Börsengehandelte Rohstoffe	992	–	–	992
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	416	–	416
Gesamt	39.615	49.872	–	89.487
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Aktien	9.035	227	5	9.267
Anleihen	–	2.025	–	2.025
Nicht realisierte Gewinne aus Swaps	–	35	–	35
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten (Futures)	22	–	–	22
Gesamt	9.057	2.287	5	11.349
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Swaps	–	(18)	–	(18)
Gesamt	–	(18)	–	(18)
FR Multi-Asset Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Investmentfonds (CIS)	–	164.006	–	164.006
Börsengehandelte Fonds	126.595	–	–	126.595
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	4.850	–	4.850
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten (Futures)	828	–	–	828
Gesamt	127.423	168.856	–	296.279
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(1.980)	–	(1.980)
Nicht realisierte Verluste aus Terminkontrakten (Futures)	(894)	–	–	(894)
Gesamt	(894)	(1.980)	–	(2.874)

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

5. Betriebliche Erträge

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	–	–	3	–	–	–	24	16
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	–	–	11.151	7.227	257	1.786	2.620	6.448
Erträge aus der Wertpapierleihe	–	–	–	–	–	–	13	19
Nachlass auf Managementgebühren	140	108	–	–	–	–	–	–
Gesamt	140	108	11.154	7.227	257	1.786	2.657	6.483

	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	2	–	8	3	–	–	83	98
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	2.334	1.705	1.959	1.954	–	–	547	587
Zinserträge aus derivativen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	602	1.973
Dividendenerträge	–	–	–	–	–	–	6.800	10.061
Erträge aus börsengehandelten Fonds	–	–	–	–	566	786	–	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	36	34	7	10	44	131	12	17
Nachlass auf Managementgebühren	–	–	–	–	152	155	–	–
Gesamt	2.372	1.739	1.974	1.967	762	1.072	8.044	12.736

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

5. Betriebliche Erträge (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	–	–	1	–	5	1	7	15
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	–	–	–	–	–	–	25	68
Zinserträge aus derivativen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	8	189
Dividendenerträge	–	–	–	–	–	–	23	2.991
Erträge aus börsengehandelten Fonds	21	19	170	120	408	309	–	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	1	1	1	–	7	1	–	6
Nachlass auf Managementgebühren	16	17	15	15	48	44	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	99	–
Gesamt	38	37	187	135	468	355	162	3.269

	FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ²
	2024	2023	Fund 2024
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	84	10	–
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	–	–	7.393
Erträge aus börsengehandelten Fonds	923	187	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	–	–	1
Nachlass auf Managementgebühren	185	49	–
Gesamt	1.192	246	7.394

¹Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

²Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock UK Credit Screened Fund 1	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Prüfungsgebühren	(14)	(7)	(10)	(10)	(11)	(10)	(9)	(9)
Liquidationsgebühren	–	–	–	–	(27)	–	(44)	–
Managementgebühren	(429)	(336)	(246)	(229)	(33)	(90)	(35)	(44)
Sonstige betriebliche Aufwendungen	(36)	(27)	(22)	(23)	(15)	(22)	(39)	(66)
Gesamt	(479)	(370)	(278)	(262)	(86)	(122)	(127)	(119)

	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD
Prüfungsgebühren	(10)	(10)	(11)	(14)	(16)	(14)	(6)	(14)
Erstattete überhöhte betriebliche Aufwendungen	108	140	–	–	–	–	19	–
Liquidationsgebühren	–	–	(30)	–	(4)	–	–	–
Managementgebühren	(199)	(209)	(195)	(207)	(193)	(227)	(1.273)	(1.938)
Sonstige betriebliche Aufwendungen	(57)	(94)	(34)	(34)	(32)	(30)	(58)	(65)
Gesamt	(158)	(173)	(270)	(255)	(245)	(271)	(1.318)	(2.017)

	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD
Prüfungsgebühren	(15)	(15)	(39)	(28)	(38)	(28)	(9)	(10)
Erstattete überhöhte betriebliche Aufwendungen	4	4	18	4	25	–	–	–
Liquidationsgebühren	–	–	–	–	–	–	(65)	–
Managementgebühren	(430)	(450)	(488)	(543)	(818)	(845)	(52)	(217)
Sonstige betriebliche Aufwendungen	(20)	(25)	(21)	(24)	(22)	(24)	(175)	(51)
Gesamt	(461)	(486)	(530)	(591)	(853)	(897)	(301)	(278)

Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
	2024	2023	2024
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Prüfungsgebühren	(51)	(4)	(13)
Managementgebühren	(1.238)	(512)	(1.474)
Sonstige betriebliche Aufwendungen	(27)	(15)	(17)
Gesamt	(1.316)	(531)	(1.504)

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

Managementgebühren (einschließlich der Gebühren für das Investmentmanagement, den Fondsverwalter und den Treuhänder):

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf eine Gebühr in Höhe eines Jahresprozentsatzes vom NIW eines jeden Fonds oder der jeweiligen Anteilklasse wie in der „Gebühren- und Kostentabelle“ angegeben. Unterschiedlichen Anteilklassen desselben Fonds können unterschiedliche Prozentsätze berechnet werden. In dieser Hinsicht können die fälligen Gebühren höher oder geringer sein als die von anderen oder bestehenden Anteilklassen zu zahlenden Gebühren. Die Verwaltungsgesellschaft ist dafür verantwortlich, aus dieser Gebühr alle Gebühren (inkl. angemessener Aufwendungen) des Investmentmanagers (von denen ein Teil an Vertriebsstellen gezahlt werden kann, die verbundene Unternehmen des Investmentmanagers sein können), des Fondsverwalters und des Treuhänders abzuführen. Dies gilt nicht für einen möglicherweise im Hinblick auf eine besondere Anteilklasse bestehenden Kundenvertrag. In einem solchen Fall werden den dieser Klasse zuzuordnenden Vermögenswerten keine Investmentmanagementgebühren in Rechnung gestellt. Die Gebühr läuft auf täglicher Basis auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar.

Beträge, die über den maximalen Gebührensatz hinausgehen, werden als Verzicht auf Managementgebühren ausgewiesen. Der Verzicht auf Managementgebühren ist in der Anmerkung zu den betrieblichen Erträgen dargelegt.

Kundenvertrag

Anteilinhaber der Klasse unterliegen einer Gebühr in Bezug auf ihre Anlage in der jeweiligen Anteilklasse auf Basis des Kundenvertrages zwischen ihnen und dem Investmentmanager oder einem verbundenen Unternehmen. Soweit ein Kundenvertrag für eine bestimmte Klasse gilt, werden Einzelheiten in der „Gebühren- und Kostentabelle“ aufgeführt.

Gebühren- und Kostentabellen

Name des Fonds	Anteilklasse	Managementgebühren (inkl. der Gebühren von Fondsverwalter, Treuhänder und Investmentmanager):	Investmentmanagementgebühr
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	Anteilklasse Institutional Distributing	0,20 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	EUR - Anteilklasse Institutional Accumulating	0,15 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	EUR - Anteilklasse Institutional Accumulating	0,15 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock UK Credit Screened Fund	Anteilklasse Flexible Accumulating	0,15 %	Kundenvertrag
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Klasse D Accumulating	0,24 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse D CHF Hedged Accumulating	0,24 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse D Distributing	0,24 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse Z Accumulating	0,19 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse Z CHF Hedged Accumulating	0,19 %	in der Managementgebühr enthalten
	Anteilklasse Flexible Accumulating	0,15 %	Kundenvertrag

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

Gebühren- und Kostentabelle (Fortsetzung)

Name des Fonds	Anteilklasse	Managementgebühren (inkl. der Gebühren von Fondsverwalter, Treuhänder und Investmentmanager):	Investmentmanagementgebühr
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	EUR - Anteilklasse Flexible Accumulating	0,15 %	Kundenvertrag
	EUR - Anteilklasse Institutional Accumulating	0,15 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Anteilklasse Institutional 1 Distributing	0,50 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Anteilklasse Institutional 2 Distributing	0,50 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse D Accumulating	1,10 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Global Equity Selection Fund	Klasse Z Accumulating	1,10 %	in der Managementgebühr enthalten
	Anteilklasse Flexible Accumulating	0,30 %	Kundenvertrag
	Anteilklasse Institutional Accumulating	1,10 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse A Accumulating	2,10 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Klasse D Accumulating	1,05 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse E Accumulating	2,75 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse D Accumulating	0,95 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Klasse E Accumulating	2,45 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse A Accumulating	1,85 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	Klasse D Accumulating	0,90 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse E Accumulating	2,15 %	in der Managementgebühr enthalten
	Anteilklasse Flexible Accumulating	0,15 %	Kundenvertrag
	Klasse A Accumulating	0,85 %	in der Managementgebühr enthalten
FR Multi-Asset Fund	Anteilklasse Flexible Accumulating	0,20 %	Kundenvertrag
	Institutional EUR Accumulating	0,55 %	in der Managementgebühr enthalten
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Institutional SEK Hedged Accumulating	0,55 %	in der Managementgebühr enthalten
	Anteilklasse Institutional USD Accumulating Hedged	0,55 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse C CHF Hedged Accumulating	0,70 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse C CHF Hedged Distributing	0,70 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse C EUR Hedged Accumulating	0,70 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse C EUR Hedged Distributing	0,70 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse C USD Hedged Accumulating	0,70 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse C USD Hedged Distributing	0,70 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse D EUR Hedged Accumulating	0,25 %	in der Managementgebühr enthalten
	Klasse D EUR Hedged Distributing	0,25 %	in der Managementgebühr enthalten
Klasse E EUR Hedged Accumulating	0,85 %	in der Managementgebühr enthalten	
Klasse E EUR Hedged Distributing	0,85 %	in der Managementgebühr enthalten	

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

Erstattete überhöhte betriebliche Aufwendungen

Der Investmentmanager beabsichtigt, alle zusätzlichen Aufwendungen, die innerhalb der Fonds gezahlt werden, zu begrenzen, so dass die TER für jede Anteilklasse (einschließlich der Betriebskosten und Aufwendungen der zugrunde liegenden Fondsanlagen und ohne Managementgebühren) die nachstehenden Sätze nicht überschreitet.

Name des Fonds	Anteilklasse	Gebührenobergrenze
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Klasse D Accumulating	0,24 %
	Klasse D Distributing	0,24 %
	Klasse D CHF Hedged Accumulating	0,24 %
	Klasse Z Accumulating	0,19 %
	Klasse Z CHF Hedged Accumulating	0,19 %
	Anteilklasse Flexible Accumulating	0,03 %
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Klasse D Accumulating	0,14 %
	Klasse Z Accumulating	0,14 %
	Anteilklasse Institutional Accumulating	0,14 %
	Anteilklasse Flexible Accumulating	0,14 %
BlackRock Global Equity Selection Fund	Klasse D Accumulating	0,85 %
	Klasse E Accumulating	2,11 %
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Klasse D Accumulating	0,75 %
	Klasse E Accumulating	1,90 %
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Klasse D Accumulating	0,61 %
	Klasse E Accumulating	1,61 %

Kreditverwaltungsgebühren

JPMorgan hat als Verwaltungsstelle des Kreditvertrags gemeinsam mit den anderen syndizierten Kreditgebern einen Teil einer Kreditfazilität über 450.000.000 USD bereitgestellt, die den Fonds zur Verfügung steht. Für diese Kreditfazilität fallen täglich Kreditbereitstellungsgebühren zu einem Satz von 0,10 % pro Jahr an, die von allen Fonds bezahlt werden müssen. Diese Gebühr ist rückwirkend vierteljährlich zahlbar. Im Geschäftsjahr wurden keine Kreditverwaltungsgebühren erhoben. Weitere Einzelheiten zu der Kreditfazilität-Vereinbarung sind in Anmerkung 16 aufgeführt.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

7. Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	
	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. GBP	2023 Tsd. GBP
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	6	(135)	(13.281)	(6.069)	(18.500)	(11.535)	(22.985)	(23.484)
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	(235)	146	–	–	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	37.771	(5.378)	35.833	(39.653)	17.829	(7.751)	22.817	(12.488)
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	123	(138)	–	–	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	178	(65)	–	–	–	–	–	–
Gesamt	37.955	(5.578)	22.440	(45.714)	(671)	(19.286)	(168)	(35.972)

	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	(1.079)	(1.742)	(11.024)	(3.940)	(79)	(3.527)	3.664	(25.835)
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	138	540	237	(596)	–	(1.953)	976	(5.558)
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	3.870	(2.380)	10.769	(2.334)	3.667	(1.762)	20.026	(2.255)
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	28	(117)	(710)	1.535	–	240	(526)	(3.667)
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	(131)	(161)	(88)	(3.475)	1	4	(6.888)	(11.756)
Gesamt	2.826	(3.860)	(816)	(8.810)	3.589	(6.998)	17.252	(49.071)

¹Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

7. Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	1.326	1.366	582	(633)	1.026	(1.210)	(772)	(8.365)
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	(152)	(1.064)	(448)	(2.132)	264	1.196
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	4.515	(2.587)	2.756	(1.978)	5.763	(3.998)	876	(10.406)
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	(120)	229	(487)	670	(53)	(3.311)
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	61	312	165	944	513	1.448	(452)	(7.346)
Gesamt	5.902	(909)	3.231	(2.502)	6.367	(5.222)	(137)	(28.232)

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

7. Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

	FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
	2024	2023	2024
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	5.561	585	547
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	10.230	(10.701)	(85)
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	30.549	3.739	2.976
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	(9.302)	2.805	45
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	(3.206)	(1.130)	100
Gesamt	33.832	(4.702)	3.583

¹Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

8. Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen

	BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock UK Credit Screened Fund		BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Sonstige Zinsen	(1)	(1)	(1)	(2)	(1)	(1)	(1)	(2)
Gesamt	(1)	(1)	(1)	(2)	(1)	(1)	(1)	(2)

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

8. Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen (Fortsetzung)

	BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund		FR Multi-Asset Fund	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Zinsaufwendungen für derivative Finanzinstrumente	(348)	(133)	–	–	(9)	(15)	–	–
Sonstige Zinsen	(19)	(14)	–	(2)	(1)	(1)	(2)	(1)
Gesamt	(367)	(147)	–	(2)	(10)	(16)	(2)	(1)

9. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile

Das Unternehmen kann Dividenden für jede ausschüttende Anteilklasse des Unternehmens beschließen und auszahlen. Gemäß dem Prospekt verfällt jedwede Dividende, die zwölf Jahre nach ihrem Beschlussdatum nicht beansprucht ist, hört auf, eine Schuld des Unternehmens gegenüber Anlegern zu sein und geht in das Eigentum des betreffenden Fonds über.

Die im Geschäftsjahr beschlossenen Ausschüttungen waren wie folgt:

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Mai	–	–	–	–	–	(107)	–
September	–	–	–	–	–	–	(232)
Dezember	–	–	–	–	–	–	(308)
März	–	(2.678)	(81)	(48)	–	–	(306)
Beschlossene Ausschüttungen	–	(2.678)	(81)	(48)	–	(107)	(846)
Erträge aus Ertragsausgleich	–	–	(1)	(1)	–	(18)	–
Aufwendungen aus Ertragsausgleich	–	–	9	–	–	–	–
Gesamt	–	(2.678)	(73)	(49)	–	(125)	(846)

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

10. Besteuerung

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2024

	BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD
Tatsächliche Steuern								
Nicht erstattungsfähige ausländische Quellensteuer auf Zinseinkünfte	(5)	(1)	–	(2)	(16)	(37)	(833)	(1.134)
Latente Steuern								
Rückstellung für ausländische Kapitalertragsteuerverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	(658)	(90)
Steuern - Gesamt	(5)	(1)	–	(2)	(16)	(37)	(1.491)	(1.224)

¹Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

	BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
	2024	2023
	Tsd. USD	Tsd. USD
Tatsächliche Steuern		
Nicht erstattungsfähige ausländische Quellensteuer auf Zinseinkünfte	(2)	(325)
Latente Steuern		
Rückstellung für ausländische Kapitalertragsteuerverbindlichkeiten	3	(3)
Steuern - Gesamt	1	(328)

¹Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

10. Besteuerung (Fortsetzung)

Irische Steuern

Nach der geltenden irischen Rechtslage und Rechtspraxis erfüllt das Unternehmen die Voraussetzungen eines Anlageorganismus gemäß der Definition in Section 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 (in der jeweils gültigen Fassung). Auf dieser Grundlage unterliegt es keiner irischen Steuer auf seine Erträge oder Kapitalgewinne. Es kann jedoch bei Eintritt eines steuerlich relevanten Ereignisses („Chargeable Event“) eine Steuerpflicht in Irland entstehen. Zu den steuerlich relevanten Ereignissen zählen alle Ausschüttungen an Anteilinhaber oder Einlösungen, Rücknahmen, Annullierungen oder Übertragungen von Anteilen und der Besitz von Anteilen am Ende jedes achtjährigen Zeitraums, beginnend mit dem Erwerb dieser Anteile.

Bei steuerlich relevanten Ereignissen werden für das Unternehmen keine irischen Steuern fällig im Falle von:

- a) einem Anteilinhaber, der zum Zeitpunkt des steuerlich relevanten Ereignisses im steuerrechtlichen Sinn weder in Irland wohnhaft ist noch seinen gewöhnlichen Aufenthalt hat, unter der Voraussetzung, dass er bei dem Unternehmen entsprechende gültige Erklärungen gemäß den Bestimmungen des Steuerkonsolidierungsgesetzes (Taxes Consolidation Act) von 1997, in der jeweils gültigen Fassung, eingereicht hat oder das Unternehmen von der irischen Steuerbehörde (Irish Revenue) ermächtigt wurde, Bruttoauszahlungen vorzunehmen, wenn ihm keine solchen Erklärungen vorliegen; und
- b) bestimmten, von der Steuerpflicht befreiten, in Irland ansässigen Anteilinhabern, die dem Unternehmen die erforderlichen unterzeichneten jährlichen Erklärungen vorgelegt haben.

Ausländische Steuern

Durch das Unternehmen gegebenenfalls aus Anlagen erzielte Dividenden, Zinsen und Veräußerungsgewinne können einer Quellensteuer unterliegen, die von dem Land erhoben wird, aus dem die Anlageerträge/-gewinne stammen, und solche Steuern können von dem Unternehmen oder seinen Anteilinhabern gegebenenfalls nicht zurückgefordert werden.

Für Rechnungslegungszwecke und gemäß FRS 102 muss das Unternehmen eine Rückstellung für latente Steuerverbindlichkeiten bilden, die sich aus wesentlichen temporären Unterschieden zwischen der Besteuerung nicht realisierter Gewinne im Abschluss und den tatsächlich realisierbaren steuerbaren Gewinnen ergeben.

Die Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung („OECD“) hat unlängst Mustervorschriften für ein globales Mindeststeuersystem („zweite Säule“) herausgegeben, die für Rechnungsperioden gelten, welche am oder nach dem 31. Dezember 2023 beginnen. Infolgedessen ist derzeit nicht bekannt oder verlässlich bestimmbar, ob das Unternehmen in den Geltungsbereich der zweiten Säule fällt sowie inwieweit es – wenn überhaupt – möglicherweise Einkommensteuern der zweiten Säule unterliegt.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen

Zum 31. März 2024

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	–	–	–	–	–	–	–	1
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	–	–	7.664	4.391	–	823	11	2.128
Forderungen aus Nachlass auf Managementgebühren	13	10	–	–	–	–	–	–
Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren	–	–	7.859	1.782	–	2.577	–	–
Forderungen aus Erträgen der Wertpapierleihe	–	–	–	–	–	–	–	1
Gesamt	13	10	15.523	6.173	–	3.400	11	2.130

	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD
Forderungen aus Dividendenerträgen	–	–	–	–	–	–	759	1.185
Zinsforderungen aus börsengehandelten Fonds	–	–	–	–	283	225	–	–
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	–	–	–	–	–	–	7	5
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	888	807	2	681	–	–	–	–
Zinsforderungen aus derivativen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	266	206
Forderungen aus Nachlass auf Managementgebühren	–	–	–	–	12	13	–	–
Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren	208	–	–	111	–	–	7.173	5.553
Forderungen aus Erträgen der Wertpapierleihe	3	3	–	1	4	12	–	1
Sonstige Forderungen	1	3	–	12	–	–	–	6
Gesamt	1.100	813	2	805	299	250	8.205	6.956

¹Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD
Forderungen aus Dividendenerträgen	–	–	–	–	–	–	–	47
Zinsforderungen aus börsengehandelten Fonds	–	2	–	–	–	5	–	–
Zinsforderungen aus derivativen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	–	18
Forderungen aus Nachlass auf Managementgebühren	2	3	3	4	10	11	–	–
Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren	350	28	662	–	1.119	–	–	657
Forderungen aus Erträgen der Wertpapierleihe	–	–	–	–	1	–	–	–
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	1	20	–	30	77	80	–	–
Sonstige Forderungen	–	–	55	–	42	–	–	–
Gesamt	353	53	720	34	1.249	96	–	722

¹Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

	FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
	2024	2023	2024
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	6	1	–
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	–	–	2.741
Forderungen aus Nachlass auf Managementgebühren	15	15	–
Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren	11.013	806	–
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	262	–	–
Sonstige Forderungen	265	–	2
Gesamt	11.561	822	2.743

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten

Zum 31. März 2024

	BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund		BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1		BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1 ¹		BlackRock UK Credit Screened Fund ¹	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Zahlbare Prüfungsgebühren	7	13	10	20	10	20	9	18
Zahlbarer Liquidationsaufwand	–	–	–	–	27	–	44	–
Zahlbare Managementgebühren	248	132	60	59	1	26	18	26
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	–	–	8.579	2.684	–	1.463	–	349
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	–	–	–	914	–	1.279	–	–
An Anleger zu zahlende Restbeträge	–	–	–	–	–	–	24	–
Sonstige Verbindlichkeiten	61	29	52	28	42	24	134	94
Gesamt	316	174	8.701	3.705	80	2.812	229	487

	BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund ¹		BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. USD	Tsd. USD
Zahlbare Prüfungsgebühren	10	20	19	28	15	29	15	30
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	81	48	–	–	–	–	–	–
Erstattete überhöhte betriebliche Aufwendungen	(188)	(126)	–	–	–	–	(19)	–
Zinsverbindlichkeiten für derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	–	77	49
Zahlbarer Liquidationsaufwand	–	–	30	–	4	–	–	–
Zahlbare Managementgebühren	206	133	38	54	24	35	236	276
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	–	649	–	1.079	–	172	7.014	7.681
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	72	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten	93	53	64	34	44	21	308	38
Gesamt	274	777	151	1.195	87	257	7.631	8.074

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

	BlackRock Global Equity Selection Fund		BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund		BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund		BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund ¹	
	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. EUR	2023 Tsd. EUR	2024 Tsd. USD	2023 Tsd. USD
Zahlbare Prüfungsgebühren	14	29	26	28	26	28	20	22
Erstattete überhöhte betriebliche Aufwendungen	(9)	(4)	(10)	(4)	(26)	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten für derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	3
Zahlbarer Liquidationsaufwand	–	–	–	–	–	–	65	–
Zahlbare Managementgebühren	55	60	54	65	89	103	87	126
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	318	–	636	–	968	–	–	464
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	34	6	25	37	187	117	–	–
An Anleger zu zahlende Restbeträge	–	–	–	–	–	–	15	–
Sonstige Verbindlichkeiten	52	23	55	25	53	21	100	43
Gesamt	464	114	786	151	1.297	269	287	658

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

	FR Multi-Asset Fund		BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 ¹
	2024	2023	2024
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Zahlbare Prüfungsgebühren	28	4	13
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	–	–	306
Zahlbare Managementgebühren	172	157	149
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	11.485	2.833	–
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	–	–	104
Sonstige Verbindlichkeiten	14	6	7
Gesamt	11.699	3.000	579

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

13. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert

Der nachstehende NIW je Anteil zum 31. März 2024 wurde für Abschlusszwecke gemäß FRS 102 erstellt. Da der 29. März 2024 ein Feiertag war, wurde der letzte gemäß dem Prospekt für den Anlegerhandel berechnete NIW je Anteil am 28. März 2024 veröffentlicht.

Zum 31. März 2024

		2024	2023	2022
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund				
Anteilklasse Institutional Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	188.619	147.003	107.521
Anteile im Umlauf		16.643.108	16.209.504	10.890.315
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	11,33	9,07	9,87
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1				
EUR - Anteilklasse Institutional Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	716.193	500.760	491.376
Anteile im Umlauf		68.221.088	50.909.999	46.169.540
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,50	9,84	10,64
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1¹				
EUR - Anteilklasse Institutional Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	80.280	151.866
Anteile im Umlauf		–	8.489.005	14.152.817
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	–	9,46	10,73
BlackRock UK Credit Screened Fund¹				
Anteilklasse Flexible Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	–	124.726	258.941
Anteile im Umlauf		–	8.083.166	15.014.988
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	–	15,43	17,25
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund				
Klasse D Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	17.667	17.204	19.305
Anteile im Umlauf		1.669.291	1.732.573	1.890.014
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,58	9,93	10,21
Klasse D CHF Hedged Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. CHF	1.437	1.757	2.054
Anteile im Umlauf		142.309	181.309	204.301
Nettoinventarwert je Anteil	CHF	10,10	9,69	10,05
Klasse D Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	3.244	2.641	2.937
Anteile im Umlauf		353.040	298.890	317.390
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	9,19	8,84	9,25
Klasse Z Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	45.929	53.099	58.435
Anteile im Umlauf		4.324.040	5.330.953	5.706.066
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,62	9,96	10,24
Klasse Z CHF Hedged Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. CHF	5.452	9.257	10.038
Anteile im Umlauf		538.691	953.267	997.099
Nettoinventarwert je Anteil	CHF	10,12	9,71	10,07
Anteilklasse Flexible Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	5	5	5
Anteile im Umlauf		482	482	482
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,74	10,05	10,32
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund¹				
EUR - Anteilklasse Flexible Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	2.360	2.530
Anteile im Umlauf		–	233.040	233.040
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	–	10,13	10,86
EUR - Anteilklasse Institutional Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	94.453	101.420
Anteile im Umlauf		–	10.634.678	10.634.678
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	–	8,88	9,54
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund				
Anteilklasse Institutional 1 Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	66.069	62.160	66.376
Anteile im Umlauf		7.050.651	7.050.651	7.050.651
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	9,37	8,82	9,41
Anteilklasse Institutional 2 Distributing²				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	4.476	23.675
Anteile im Umlauf		–	504.460	2.498.501

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

13. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2024	2023	2022
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Institutional 2 Distributing² (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	–	8,88	9,48
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund				
Klasse D Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1	1	1
Anteile im Umlauf		100	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	11,03	10,18	11,36
Klasse Z Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	174.452	160.971	179.331
Anteile im Umlauf		16.007.366	16.007.366	16.007.366
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10,90	10,06	11,20
Anteilklasse Flexible Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	97.368	76.784	86.782
Anteile im Umlauf		8.605.732	7.398.968	7.551.375
Nettoinventarwert je Anteil	USD	11,31	10,38	11,49
Anteilklasse Institutional Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1	7.828	118.619
Anteile im Umlauf		100	779.556	10.581.890
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10,87	10,04	11,21
BlackRock Global Equity Selection Fund				
Klasse A Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	633	2.347	2.931
Anteile im Umlauf		36.029	159.977	191.556
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	17,57	14,67	15,30
Klasse D Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	12.245	10.141	11.613
Anteile im Umlauf		581.307	582.600	646.717
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	21,07	17,41	17,96
Klasse E Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	17.851	17.192	19.011
Anteile im Umlauf		949.079	1.092.429	1.156.349
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	18,81	15,74	16,44
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund				
Klasse D Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	7.718	8.964	11.052
Anteile im Umlauf		589.215	755.868	874.575
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	13,10	11,86	12,64
Klasse E Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	23.608	26.717	31.266
Anteile im Umlauf		1.994.694	2.464.626	2.675.831
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	11,84	10,84	11,68
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund				
Klasse A Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	536	877	1.210
Anteile im Umlauf		48.441	84.695	109.311
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	11,07	10,35	11,07
Klasse D Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	40.562	50.994	47.122
Anteile im Umlauf		3.368.630	4.570.717	3.987.951
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	12,04	11,16	11,82
Klasse E Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	37.576	38.580	39.273
Anteile im Umlauf		3.401.627	3.732.351	3.551.738
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	11,05	10,34	11,06
Anteilklasse Flexible Accumulating³				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	5	5	–
Anteile im Umlauf		475	475	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	11,09	10,24	–
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund¹				
Klasse A Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	1	1
Anteile im Umlauf		–	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	–	9,18	10,49
Anteilklasse Flexible Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	11.588	270.119
Anteile im Umlauf		–	1.225.941	25.184.855

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

13. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2024	2023	2022
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund¹ (Fortsetzung)				
Klasse Flexible Accumulating (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	USD	–	9,45	10,73
Anteilklasse Flexible NZD Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. NZD	–	8	–
Anteile im Umlauf		–	810	–
Nettoinventarwert je Anteil	NZD	–	10,15	–
FR Multi-Asset Fund				
Institutional EUR Accumulating³				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	40.051	34.578	–
Anteile im Umlauf		3.538.647	3.455.554	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	11,32	10,01	–
Institutional SEK Hedged Accumulating³				
Nettoinventarwert	Tsd. SEK	2.160.710	2.264.352	–
Anteile im Umlauf		19.136.109	22.657.655	–
Nettoinventarwert je Anteil	SEK	112,91	99,94	–
Institutional USD Accumulating Hedged³				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	78.127	67.884	–
Anteile im Umlauf		6.501.463	6.501.463	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	12,02	10,44	–
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026⁴				
Klasse C CHF Hedged Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. CHF	175	–	–
Anteile im Umlauf		17.049	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	CHF	10,25	–	–
Klasse C CHF Hedged Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. CHF	426	–	–
Anteile im Umlauf		42.009	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	CHF	10,14	–	–
Klasse C EUR Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	817	–	–
Anteile im Umlauf		78.149	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,46	–	–
Klasse C EUR Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	7.403	–	–
Anteile im Umlauf		714.709	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,36	–	–
Klasse C USD Hedged Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.473	–	–
Anteile im Umlauf		233.093	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10,61	–	–
Klasse C USD Hedged Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.526	–	–
Anteile im Umlauf		240.581	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10,50	–	–
Klasse D EUR Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	10.772	–	–
Anteile im Umlauf		1.026.655	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,49	–	–
Klasse D EUR Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	4.322	–	–
Anteile im Umlauf		417.200	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,36	–	–
Klasse E EUR Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	112.493	–	–
Anteile im Umlauf		10.769.148	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,45	–	–
Klasse E EUR Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	84.938	–	–
Anteile im Umlauf		8.197.696	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	10,36	–	–

¹ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen.

² Die Anteilklasse wurde während des vorherigen Geschäftsjahres geschlossen.

³ Die Anteilklasse wurde im vorherigen Geschäftsjahr aufgelegt. Daher liegen für das Geschäftsjahr zum 31. März 2022 keine Vergleichsdaten vor.

⁴ Der Fonds wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Wechselkurse

Zum 31. März 2024 und zum 31. März 2023 galten folgende Wechselkurse:

	31. März 2024	31. März 2023
EUR = 1		
AUD	1,6554	1,6222
CAD	1,4615	1,4703
CHF	0,9728	0,9925
CLP	1.059,3180	858,9582
CNY	7,8412	7,4610
COP	4.174,4700	5.062,1073
CZK	25,2860	23,4770
DKK	7,4590	7,4493
GBP	0,8549	0,8787
HKD	8,4526	8,5286
HUF	394,0400	380,3501
IDR	17.123,4001	16.290,7743
ILS	3,9568	3,9119
JPY	163,4526	144,5956
KRW	1.453,9500	1.414,3949
MXN	17,9515	19,6169
MYR	5,1116	4,7940
NOK	11,7165	11,3785
NZD	1,8056	1,7365
PEN	4,0181	4,0862
PLN	4,3068	4,6805
RON	4,9701	4,9474
RUB	99,9810	84,4172
SEK	11,5480	11,2660
SGD	1,4576	1,4445
THB	39,4065	37,1512
USD	1,0800	1,0864
ZAR	20,4512	19,2763
GBP = 1		
EUR	1,1697	1,1381
USD = 1		
AED	3,6722	3,6725
BRL	5,0056	5,0703
CLP	980,8500	790,6100
CNH	7,2604	6,8673
CNY	7,2604	6,8673
CZK	23,4130	21,6089
EUR	0,9259	0,9204
GBP	0,7916	0,8088
HKD	7,8265	7,8500
HUF	364,8519	350,0852
IDR	15.855,0000	14.994,5000
INR	83,4025	82,1825
KRW	1.346,2500	1.301,8500
KWD	0,3076	0,3069
MXN	16,6218	18,0560
MYR	4,7330	4,4125
NZD	1,6718	1,5983
PHP	56,2150	54,3650
PLN	3,9878	4,3081
QAR	3,6470	3,6711
RUB	92,5750	77,7000
SAR	3,7505	3,7537
THB	36,4875	34,1950
TRY	32,3520	19,1950
TWD	32,0035	30,4475
ZAR	18,9363	17,7425

15. Transaktionen mit nahestehenden Parteien

Parteien gelten als nahestehend, wenn eine Partei die Möglichkeit hat, die Kontrolle über die andere Partei auszuüben, oder in der Lage ist, bei finanziellen oder betrieblichen Entscheidungen entscheidenden Einfluss auf die andere Partei auszuüben.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

15. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

Die folgenden Unternehmen waren im Geschäftsjahr zum 31. März 2024 dem Unternehmen nahestehende Parteien:

Investmentmanager: Investmentmanager, Promoter, Vertriebsstelle und Vermittler für Wertpapierleihen: Unter-Investmentmanager:	BlackRock Asset Management Ireland Limited BlackRock Advisors (UK) Limited BlackRock Financial Management, Inc. BlackRock Institutional Trust Company, N.A. BlackRock Investment Management (UK) Limited BlackRock (Singapore) Limited
Zahlstelle in Schweden: Vertreter in Dänemark: Vertreter in der Schweiz:	BlackRock Investment Management (UK) Limited BlackRock Copenhagen Branch BlackRock Asset Management Schweiz AG

Die übergeordnete Holdinggesellschaft der Verwaltungsgesellschaft, des Investmentmanagers, des Promoters, der Vertriebsstelle, des Vermittlers für Wertpapierleihen, der Unter-Investmentmanager, der Zahlstelle in Schweden und des Vertreters in Dänemark und der Schweiz ist die BlackRock Inc., ein in Delaware, USA, gegründetes Unternehmen.

Der Investmentmanager hat bestimmte Portfoliomanagementfunktionen an die Unter-Investmentmanager delegiert, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

Name des Fonds	Unter-Investmentmanager
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	BlackRock (Singapore) Limited
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Global Equity Selection Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	BlackRock Institutional Trust Company, N.A.
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	BlackRock Financial Management, Inc.

Der Investmentmanager veranlasst, dass Gebühren und Auslagen der Unter-Investmentmanager aus den eigenen Gebühren des Investmentmanagers bezahlt werden.

Die an die Verwaltungsgesellschaft im Laufe des Geschäftsjahres gezahlten Gebühren, die Art dieser Transaktionen und zum Ende des Geschäftsjahres offene Salden finden sich jeweils in den Anmerkungen 6 und 10.

Die Verwaltungsratsmitglieder zum 31. März 2024 sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

Verwaltungsratsmitglieder	Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe	Verwaltungsratsmitglied bei verbundenen Unternehmen von BlackRock und/oder von BlackRock verwalteten Fonds
Rosemary Quinlan	Nein	Nein
Patrick Boylan	Ja	Ja
Maria Ging	Ja	Nein
Michael Hodson	Nein	Nein
Enda McMahon	Ja	Ja
Justin Mealy	Ja	Nein
Adele Spillane	Nein	Nein
Catherine Woods	Nein	Nein

Die Verwaltungsratsmitglieder, die ebenfalls Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe sind, haben keinen Anspruch auf eine Vergütung für Verwaltungsratsmitglieder.

Das Unternehmen erstattet der Verwaltungsgesellschaft den Anteil an den Honoraren, die den Verwaltungsratsmitgliedern in seinem Namen gezahlt wurden.

Anteile an anderen Fonds, die von BlackRock verbundenen Unternehmen von BlackRock verwaltet werden

Anlagen in von BlackRock Inc. und verbundenen Unternehmen von BlackRock verwalteten Fonds sind nachstehend aufgeführt und in der Aufstellung der Vermögenswerte des jeweiligen Fonds gekennzeichnet. Für zugrunde liegende Fonds, die Investmentmanagement- oder Performance-Gebühren unterliegen, wurden diese an den Fonds zurückerstattet.

Das Unternehmen investiert in die folgenden Fonds, die ebenfalls von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Die aus diesen Fonds nahestehender Parteien vereinnahmten Erträge entnehmen Sie bitte den betrieblichen Erträgen. Weitere Informationen zu den Gebühren, die durch Anlagen in diese zugrunde liegenden Fonds erhoben wurden, sind der nachstehenden Tabelle zu entnehmen. Bei den hier angegebenen Gebühren handelt es sich um die Höchstgebühren, die gemäß dem Prospekt der zugrunde liegenden Fonds erhoben werden können; die tatsächlichen erhobenen Gebühren können niedriger sein:

Anlagen	Vom Fonds gezahlte Gebühr
ICAV – in Irland von der CBI zugelassene OGAW	
BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Klasse X EUR Accumulating	k. A. ¹
BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund – Klasse X EUR Hedged Accumulating	k. A. ¹
BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund – Klasse Z EUR Hedged Accumulating	Jahresaufwand auf 0,30 % des NIW begrenzt ¹
BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	k. A. ¹
BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating	k. A. ¹
BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Klasse X EUR Accumulating	k. A. ¹

NM07241I-3752176-74/238

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

15. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

Anteile an anderen Fonds, die von BlackRock verbundenen Unternehmen von BlackRock verwaltet werden (Fortsetzung)

Anlagen	Vom Fonds gezahlte Gebühr
BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund – Klasse X USD Accumulating	k. A. ¹
BlackRock Tactical Opportunities Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	k. A. ¹
Investmentgesellschaft - in Deutschland als OGAW zugelassen durch die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)	
iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF (DE)	Jahresaufwand auf 0,46 % des NIW begrenzt ¹
Investmentgesellschaft - in Irland von der CBI zugelassene OGAW	
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	Jahresaufwand auf 0,03 % des NIW begrenzt ²
iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,07 % des NIW begrenzt ¹
iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist)	Jahresaufwand auf 0,07 % des NIW begrenzt ¹
iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	Jahresaufwand auf 0,15 % des NIW begrenzt ¹
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	Jahresaufwand auf 0,09 % des NIW begrenzt ¹
iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	Jahresaufwand auf 0,50 % des NIW begrenzt ¹
iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	Jahresaufwand auf 0,25 % des NIW begrenzt ¹
iShares Bloomberg Enhanced Roll Yield Commodity Swap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,28 % des NIW begrenzt ¹
iShares China CNY Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Anteilklasse GBP (Dist)	Jahresaufwand auf 0,07 % des NIW begrenzt ¹
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,20 % des NIW begrenzt ¹
iShares Core S&P 500 UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,07 % des NIW begrenzt ¹
iShares Core UK Gilts ETF – Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Klasse US Dollar Flexible Accumulating	Jahresaufwand auf 0,30 % des NIW begrenzt ³
iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	Jahresaufwand auf 0,25 % des NIW begrenzt ¹
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible Euro Hedged Accumulating	k. A. ⁴
iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Klasse Euro Flexible Accumulating	Jahresaufwand auf 0,30 % des NIW begrenzt ³
iShares ESG Screened Euro Corporate Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible Euro Accumulating	k. A. ⁴
iShares ESG Screened Global Corporate Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse D EUR Hedged Accumulating	Jahresaufwand auf 0,35 % des NIW begrenzt ⁴
iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	Jahresaufwand auf 0,25 % des NIW begrenzt ¹
iShares Green Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible EUR Hedged Accumulating	k. A. ⁵
iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI Canada UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,48 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,23 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	Jahresaufwand auf 0,15 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI Europe ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	Jahresaufwand auf 0,12 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,20 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,15 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist)	Jahresaufwand auf 0,60 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,10 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,07 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI USA Value Factor ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,20 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,20 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,25 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,35 % des NIW begrenzt ¹
iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	Jahresaufwand auf 0,30 % des NIW begrenzt ¹
iShares Pacific Index Fund (IE) - Klasse US Dollar Flexible Accumulating	Jahresaufwand auf 0,30 % des NIW begrenzt ³
iShares Physical Gold ETC	Jahresaufwand auf 0,12 % des NIW begrenzt ¹
iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	Jahresaufwand auf 1,00 % des NIW begrenzt ¹
Investmentgesellschaft - in Luxemburg als OGAW zugelassen durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier	
BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Klasse X2 USD Hedged	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - European Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund - Klasse X2 EUR Hedged	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Klasse X2 EUR Hedged	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

15. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

Anteile an anderen Fonds, die von BlackRock verbundenen Unternehmen von BlackRock verwaltet werden (Fortsetzung)

Anlagen	Vom Fonds gezahlte Gebühr
BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund – Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund – Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - World Real Estate Securities Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Klasse X2 USD	k. A. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund – Klasse X2 EUR	k. A. ⁶
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund – Klasse X2 EUR	k. A. ⁶

- ¹ Die zugrunde liegenden Fonds wenden eine „All-in-One“-Gebührenstruktur an. Jeder Fonds zahlt alle seine Gebühren, Betriebskosten und Ausgaben als einzige Pauschalgebühr (TER).
- ² Die Verwaltungsgesellschaft dieser Anlagen ist für die Abführung der jährlichen Aufwendungen der Fonds aus ihrem Honorar verantwortlich. Wenn die tatsächlichen Gebühren und Kosten den an die Verwaltungsgesellschaft gezahlten Betrag übersteigen, wird die Verwaltungsgesellschaft den Mehrbetrag aus ihrem Vermögen begleichen.
- ³ Die Verwaltungsgesellschaft dieser Anlagen hat Anspruch auf eine Gebühr in Höhe von 0,30 % pro Jahr. Die an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Verwaltungsgebühr enthält die Gebühr der Verwaltungsgesellschaft, des Fondsverwalters und des Treuhänders.
- ⁴ Die Verwaltungsgesellschaft dieser Anlagen hat Anspruch auf eine Gebühr in Höhe von 0,03 % pro Jahr des NIW der einzelnen Fonds oder der jeweiligen Anteilklasse. Wenn die tatsächlichen Gebühren und Kosten den an die Verwaltungsgesellschaft gezahlten Betrag übersteigen, wird die Verwaltungsgesellschaft den Mehrbetrag aus ihrem Vermögen begleichen.
- ⁵ Die Verwaltungsgesellschaft dieser Anlagen hat Anspruch auf eine Gebühr in Höhe von 0,05 % pro Jahr des NIW der einzelnen Fonds oder der jeweiligen Anteilklasse. Wenn die tatsächlichen Gebühren und Kosten den an die Verwaltungsgesellschaft gezahlten Betrag übersteigen, wird die Verwaltungsgesellschaft den Mehrbetrag aus ihrem Vermögen begleichen.
- ⁶ Der Fonds unterliegt in Bezug auf diese Anlage keiner Managementgebühr. Die zugrunde liegenden Fonds zahlen der Verwaltungsgesellschaft, BlackRock Luxembourg S.A., jedoch eine Verwaltungsgebühr. Die Verwaltungsgebühr darf nicht höher sein als 0,25 % und 0,30 % pro Jahr für BlackRock Global Funds bzw. BlackRock Strategic Funds.

Alle Transaktionen mit nahestehenden Parteien wurden wie Geschäfte mit unabhängigen Dritten im normalen Geschäftsgang durchgeführt. Die Bedingungen und die Renditen, die die nahestehenden Parteien für diese Anlagen erhalten haben, waren nicht besser als diejenigen Bedingungen und Renditen, die andere Anleger derselben Anteilklasse erhalten haben.

Bedeutende Anleger

Die folgenden Anleger sind:

- von der BlackRock-Gruppe verwaltete Fonds oder verbundene Unternehmen von BlackRock, Inc. („BlackRock nahestehende Anleger“) oder
- Anleger (mit Ausnahme der in Punkt (a) oben genannten), die 51 % oder mehr der im Umlauf befindlichen Anteile des Unternehmens gehalten haben und demzufolge als dem Unternehmen nahestehende Parteien gelten („bedeutende Anleger“).

Zum 31. März 2024

Name des Fonds	Gesamtanteil der von BlackRock nahestehenden Anlegern gehaltenen Anteile in %	Gesamtanteil der von bedeutenden Anlegern, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind, gehaltenen Anteile in %	Anzahl der bedeutenden Anleger, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	null	100,00	1
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	null	100,00	1
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	0,01	null	null
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	null	100,00	1
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	– ¹	65,04	1
BlackRock Global Equity Selection Fund	0,01	52,51	1
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	null	57,10	1
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	0,01	null	null
FR Multi-Asset Fund	– ¹	null	null

Anlagen, die weniger als 0,005 % betragen, wurden auf null abgerundet.

NM0724U-3752176-76/238

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

15. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

Bedeutende Anleger (Fortsetzung)

Zum 31. März 2023

Name des Fonds	Gesamtanteil der von BlackRock nahestehenden Anlegern gehaltenen Anteile in %	Gesamtanteil der von bedeutenden Anlegern, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind, gehaltenen Anteile in %	Anzahl der bedeutenden Anleger, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind
BlackRock Cangrande Global Index Equity Fund	null	100,00	1
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	null	84,06	1
BlackRock Euro Sovereign Bond Index Fund 1	null	100,00	1
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	0,01	null	null
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	null	97,86	1
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	null	93,32	1
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	— ¹	66,18	1
BlackRock Global Equity Selection Fund	0,01	52,44	1
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	null	58,79	1
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	0,01	null	null
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	100,00	null	null
FR Multi-Asset Fund	— ¹	null	null

¹ Anlagen, die weniger als 0,005 % betragen, wurden auf null abgerundet.

Wertpapierleihe

Alle während des Geschäftsjahres aus der Wertpapierleihe erzielten Erträge abzüglich der Gebühren des Vermittlers für Wertpapierleihen werden an den jeweiligen Fonds gezahlt (siehe auch Anmerkung zu den betrieblichen Erträgen). Wenn Einnahmen aus der Wertpapierleihe erzielt werden, erhält der Vermittler für Wertpapierleihen eine Gebühr in Höhe von 37,5 % dieser Einnahmen und zahlt alle betrieblichen und administrativen Kosten Dritter, die mit dieser Tätigkeit im Zusammenhang stehen und in diesem Zusammenhang anfallen, aus seiner Gebühr. Soweit die an Dritte zu zahlenden Kosten für die Wertpapierleihe die von dem Vermittler für Wertpapierleihen erhaltene Gebühr übersteigen, wird der Vermittler für die Wertpapierleihen die überschüssigen Beträge aus seinem eigenen Vermögen begleichen.

Die Fonds haben zum Ende des Geschäftsjahres keine Rückstellungen für Forderungen gegenüber nahestehenden Parteien erfasst (31. März 2023: null).

Es wurden im Geschäftsjahr keine Abschreibungen für Forderungen oder Verbindlichkeiten gegenüber nahestehenden Parteien vorgenommen (31. März 2023: null).

Es wurden im Geschäftsjahr gegenüber nahestehenden Parteien keine besicherten oder unbesicherten Verpflichtungen oder Garantien eingegangen (31. März 2023: null).

16. Kreditfazilität

Der Fonds schloss mit JPMorgan eine Kreditfazilität ab, wobei JPMorgan zusammen mit anderen syndizierten Kreditgebern dem Fonds einen Teil einer Kreditfazilität in Höhe von 450.000.000 USD zur Verfügung stellte. Der Teil der Kreditfazilität von 450.000.000 USD wird dem Fonds auf der Grundlage der Kreditfazilität-Vereinbarung vom 19. April 2024 zugewiesen. Diese Kreditfazilität wird von den Fonds zur befristeten Finanzierung in Anspruch genommen, insbesondere zur Finanzierung von Rücknahmeaufträgen von Anteilhabern. Zinsen und Bereitstellungsgebühren im Zusammenhang mit der Inanspruchnahme dieser Kreditfazilität werden aus dem Vermögen der Fonds gezahlt. Keinem neuen Fonds wird automatisch eine Kreditlinie eingeräumt, und er muss daher im Rahmen eines Beitrittsverfahrens hinzugefügt werden. Dieses Verfahren umfasst unter anderem die Durchführung aller notwendigen Due-Diligence-Prüfungen, die die Kreditgeber durchführen, um die Aufnahme des neuen Fonds zu genehmigen. In diesem Geschäftsjahr wird diesen Fonds keine Kreditlinie eingeräumt noch können sie eine in Anspruch nehmen. Darüber hinaus gibt es keine Garantie, dass die Aufnahme eines neuen Fonds von den Kreditgebern genehmigt wird oder dass einem Fonds ein Kredit eingeräumt wird, da die Kreditlinie von der Verfügbarkeit (auf einer gerechten Zuteilungsbasis) zwischen dem Fonds und anderen am Kreditvertrag beteiligten Fonds von BlackRock abhängig ist. Bestimmte Fonds unterliegen daher möglicherweise nicht der Kreditlinie, und es fallen für sie keine diesbezüglichen Gebühren an.

Für diese Kreditfazilität wird täglich eine Kreditbereitstellungsgebühr erhoben, die in der Gewinn- und Verlustrechnung unter der Überschrift „Kreditverwaltungsgebühr“ ausgewiesen ist. Die Kreditbereitstellungsgebühr wird mit 0,10 % auf den ausstehenden Saldo berechnet.

Die Kreditfazilität wurde im Geschäftsjahr nicht in Anspruch genommen (31. März 2023: null).

17. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 31. März 2024 und 31. März 2023 bestanden keine wesentlichen Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

BLACKROCK UCITS FUNDS

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

18. Geschlossene Fonds

Zum 31. März 2024 hielten der BlackRock Diversified Distribution Fund, der BlackRock Diversified Strategies Selection Fund, der BlackRock Dynamic Allocation Fund, der BlackRock Euro Cash Fund, der BlackRock Fixed Income Selection Fund, der BlackRock Multi Style Strategy Fund und der BlackRock Tactical Opportunities Fund Salden in Höhe von 38 EUR in Konten des Treuhänders (2023: 76.216 EUR), 30.031 EUR (2023: 46.568 EUR), 420 EUR (2023: null), 29.979 EUR (2023: 46.280 EUR), 540 EUR (2023: 38.384 EUR), 3.028 EUR (2023: 3.693 EUR) und 6.070 USD (2023: 6.166 USD) Diese Fonds haben ihren Betrieb in früheren Jahren eingestellt. Sie wurden in diesem Bericht nicht berücksichtigt, da die endgültigen geprüften Abschlüsse in früheren Jahren erstellt wurden.

19. Ereignisse nach dem Stichtag

Am 19. April 2024 wurde eine erneute Kreditfazilität von der JPMorgan Chase Bank und anderen syndizierten Kreditgebern ausgegeben.

Am 20. Mai 2024 wurde für das Unternehmen ein aktualisierter Prospekt zur Berücksichtigung der folgenden Änderungen veröffentlicht:

- Aktualisierungen zu den Informationen über Verwaltungsratsmitglieder.
- Aktualisierungen an der Risikomanagement-Benchmark und den diesbezüglichen Kennzahlen für den BlackRock Global Equity Selection Fund und den BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund.
- Ausschluss des BlackRock Emerging Markets Sovereign Screened Bond Fund und des BlackRock UK Equity Income Fund.

Am 17. Juli 2024 wurde der BlackRock Diversifying Fixed Income Fund vollständig zurückgenommen

Abgesehen von den oben aufgeführten gab es nach Ablauf des Geschäftsjahres keine Ereignisse, die sich nach Auffassung des Verwaltungsrats auf den Jahresabschluss für das am 31. März 2024 beendete Geschäftsjahr ausgewirkt haben könnten.

20. Genehmigungsdatum

Am 19. Juli 2024 wurde der Jahresabschluss vom Verwaltungsrat genehmigt.

BLACKROCK CANGRANDE GLOBAL INDEX EQUITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
INVESTMENTFONDS (CIS)				
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 31,76 %)				
Irland (31. März 2023: 31,76 %)				
1.557.039	USD	iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Klasse US Dollar Flexible Accumulating ¹	36.370	19,28
998.459	EUR	iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Klasse Euro Flexible Accumulating ¹	18.473	9,80
44.813	USD	iShares Pacific Index Fund (IE) - Klasse US Dollar Flexible Accumulating ¹	2.705	1,43
Irland - Gesamt			57.548	30,51
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW)			57.548	30,51
Gesamtanlagen in Investmentfonds (CIS)			57.548	30,51
Börsengehandelte Fonds (31. März 2023: 68,34 %)				
Irland (31. März 2023: 68,34 %)				
67.408	EUR	iShares Core S&P 500 UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	34.491	18,29
16.829	EUR	iShares MSCI Canada UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	2.976	1,58
2.031.401	EUR	iShares MSCI Europe ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc) ¹	16.754	8,88
936.865	EUR	iShares MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	5.941	3,15
3.569.073	EUR	iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	34.936	18,52
4.243.438	EUR	iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	36.273	19,23
Irland - Gesamt			131.371	69,65
Gesamtanlagen in börsengehandelten Fonds			131.371	69,65
			Zeitwert	% des Netto-
			Tsd. EUR	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			188.919	100,16
Zahlungsmittel			3	-
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			(303)	(0,16)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert			188.619	100,00
Analyse des Gesamtvermögens				% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind				69,53
Investmentfonds (CIS)				30,46
Sonstige Vermögenswerte				0,01
Gesamtvermögen				100,00

¹ Dem Fonds nahestehende Partei.

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (31. März 2023: 99,03 %)				
Australien (31. März 2023: 1,59 %)				
200.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 22/03/2027	191	0,03
300.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 0.75%, 15/03/2029	261	0,04
250.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 15/07/2030	227	0,03
150.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 1.25%, 15/03/2033	121	0,02
200.000	EUR	Aurizon Network Pty. Ltd., 3.13%, 01/06/2026	197	0,03
400.000	EUR	Ausgrid Finance Pty. Ltd., 1.25%, 30/07/2025	388	0,05
250.000	EUR	Ausgrid Finance Pty. Ltd., 0.88%, 07/10/2031	204	0,03
300.000	EUR	AusNet Services Holdings Pty. Ltd., FRN, 1.50%, 26/02/2027	284	0,04
250.000	EUR	AusNet Services Holdings Pty. Ltd., FRN, 0.63%, 25/08/2030	209	0,03
200.000	EUR	AusNet Services Holdings Pty. Ltd., FRN, 1.63%, 11/03/2081	184	0,03
250.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 3.65%, 20/01/2026	251	0,04
200.000	EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 5.10%, 03/02/2033	206	0,03
250.000	EUR	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.75%, 29/09/2026	235	0,03
450.000	EUR	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 0.67%, 05/05/2031	417	0,06
200.000	EUR	Australia Pacific Airports Melbourne Pty. Ltd., 4.38%, 24/05/2033	210	0,03
100.000	EUR	Australia Pacific Airports Melbourne Pty. Ltd., 4.00%, 07/06/2034	102	0,02
100.000	EUR	CIMIC Finance Ltd., 1.50%, 28/05/2029	86	0,01
100.000	EUR	Commonwealth Bank of Australia, 1.13%, 18/01/2028	93	0,01
100.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.63%, 03/02/2027	92	0,01
100.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.35%, 03/03/2028	89	0,01
150.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.94%, 19/01/2029	134	0,02
300.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 4.75%, 23/01/2030	317	0,05
125.000	EUR	Macquarie Group Ltd., 0.95%, 21/05/2031	106	0,02
250.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.25%, 18/05/2026	241	0,03
525.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 2.13%, 24/05/2028	503	0,07
200.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.38%, 30/08/2028	184	0,03
100.000	EUR	National Australia Bank Ltd., 1.13%, 20/05/2031	89	0,01
100.000	EUR	Scentre Group Trust 1, REIT, 1.75%, 11/04/2028	93	0,01
150.000	EUR	Scentre Group Trust 1, REIT, 1.45%, 28/03/2029	135	0,02
100.000	EUR	Stockland Trust, REIT, 1.63%, 27/04/2026	95	0,01
100.000	EUR	Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd., 1.75%, 26/04/2028	94	0,01
225.000	EUR	Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd., 4.38%, 03/05/2033	236	0,03
100.000	EUR	Telstra Corp. Ltd., 1.13%, 14/04/2026	96	0,01
200.000	EUR	Telstra Corp. Ltd., 1.38%, 26/03/2029	184	0,03
250.000	EUR	Telstra Corp. Ltd., 1.00%, 23/04/2030	220	0,03
100.000	EUR	Telstra Group Ltd., 3.75%, 04/05/2031	102	0,02
100.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 0.06%, 13/01/2025	97	0,01
100.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 3.43%, 18/06/2026	100	0,01
200.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 2.28%, 21/10/2027	193	0,03
100.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 0.44%, 13/01/2028	90	0,01
200.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 2.00%, 28/08/2025	196	0,03
300.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.75%, 29/03/2028	282	0,04
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.45%, 16/05/2029	91	0,01
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 3.00%, 08/04/2030	97	0,01
300.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 3.71%, 12/03/2032	303	0,04
200.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 4.23%, 26/04/2033	209	0,03
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 3.97%, 12/03/2036	102	0,02
100.000	EUR	Vicinity Centres Trust, REIT, 1.13%, 07/11/2029	86	0,01
300.000	EUR	Wesfarmers Ltd., FRN, 0.95%, 21/10/2033	238	0,03
350.000	EUR	Westpac Banking Corp., 3.70%, 16/01/2026	352	0,05
150.000	EUR	Westpac Banking Corp., 1.13%, 05/09/2027	140	0,02
400.000	EUR	Westpac Banking Corp., 1.45%, 17/07/2028	371	0,05
200.000	EUR	Westpac Banking Corp., 3.80%, 17/01/2030	206	0,03
250.000	EUR	Westpac Banking Corp., FRN, 0.77%, 13/05/2031	232	0,03
200.000	EUR	Woolworths Group Ltd., FRN, 0.38%, 15/11/2028	174	0,02
Australien - Gesamt			10.435	1,46

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Österreich (31. März 2023: 1,12 %)				
200.000	EUR	A1 Towers Holding GmbH, 5.25%, 13/07/2028	211	0,03
100.000	EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 4.13%, 18/01/2027	100	0,02
100.000	EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0.38%, 03/09/2027	89	0,01
100.000	EUR	CA Immobilien Anlagen AG, REIT, 0.88%, 05/02/2027	89	0,01
200.000	EUR	CA Immobilien Anlagen AG, REIT, FRN, 1.00%, 27/10/2025	185	0,03
300.000	EUR	Erste Group Bank AG, 1.50%, 07/04/2026	289	0,04
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.88%, 22/05/2026	189	0,03
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.88%, 13/05/2027	93	0,01
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.13%, 17/05/2028	88	0,01
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.25%, 14/09/2029	84	0,01
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.25%, 27/01/2031	81	0,01
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 0.10%, 16/11/2028	177	0,03
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 4.25%, 30/05/2030	207	0,03
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 1.00%, 10/06/2030	96	0,01
200.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 4.00%, 16/01/2031	205	0,03
400.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 1.63%, 08/09/2031	376	0,05
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 0.88%, 15/11/2032	89	0,01
100.000	EUR	Erste Group Bank AG, FRN, 4.00%, 07/06/2033	98	0,01
200.000	EUR	Kommunalkredit Austria AG, 5.25%, 28/03/2029	204	0,03
100.000	EUR	Mondi Finance Europe GmbH, 2.38%, 01/04/2028	96	0,01
150.000	EUR	OMV AG, 0.00%, 03/07/2025	144	0,02
225.000	EUR	OMV AG, 1.00%, 14/12/2026	212	0,03
100.000	EUR	OMV AG, 3.50%, 27/09/2027	101	0,02
175.000	EUR	OMV AG, 2.00%, 09/04/2028	168	0,02
200.000	EUR	OMV AG, 1.88%, 04/12/2028	189	0,03
175.000	EUR	OMV AG, 0.75%, 16/06/2030	151	0,02
300.000	EUR	OMV AG, 2.38%, 09/04/2032	284	0,04
100.000	EUR	OMV AG, 1.00%, 03/07/2034	79	0,01
150.000	EUR	OMV AG, FRN, 6.25%, 12/09/2025 ¹	155	0,02
300.000	EUR	OMV AG, FRN, 2.50%, 06/01/2026 ¹	285	0,04
100.000	EUR	OMV AG, FRN, 2.88%, 06/01/2029 ¹	91	0,01
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.25%, 22/01/2025	97	0,01
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 4.13%, 08/09/2025	100	0,01
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.38%, 25/09/2026	184	0,03
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.05%, 01/09/2027	175	0,03
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 5.75%, 27/01/2028	106	0,02
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 4.75%, 26/01/2027	202	0,03
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 6.00%, 15/09/2028	104	0,02
300.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 4.63%, 21/08/2029	299	0,04
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 2.88%, 18/06/2032	181	0,03
200.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 7.38%, 20/12/2032	208	0,03
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 1.38%, 17/06/2033	83	0,01
100.000	EUR	Telekom Finanzmanagement GmbH, 1.50%, 07/12/2026	96	0,01
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, 1.38%, 09/07/2030	88	0,01
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, FRN, 2.38%, 09/12/2041	84	0,01
100.000	EUR	UNIQA Insurance Group AG, FRN, 6.00%, 27/07/2046	103	0,02
200.000	EUR	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe, 1.00%, 26/03/2036	159	0,02
100.000	EUR	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe, FRN, 4.88%, 15/06/2042	101	0,01
300.000	EUR	Volksbank Wien AG, 4.75%, 15/03/2027	308	0,04
100.000	EUR	Volksbank Wien AG, FRN, 5.75%, 21/06/2034	100	0,01
200.000	EUR	Wienerberger AG, 2.75%, 04/06/2025	197	0,03
150.000	EUR	Wienerberger AG, FRN, 4.88%, 04/10/2028	157	0,02
Österreich - Gesamt			8.037	1,12

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Belgien (31. März 2023: 2,06 %)				
200.000	EUR	Aedifica SA, REIT, 0.75%, 09/09/2031	156	0,02
100.000	EUR	AG Insurance SA, FRN, 3.50%, 30/06/2047	97	0,01
100.000	EUR	Ageas SA, FRN, 3.25%, 02/07/2049	94	0,01
100.000	EUR	Ageas SA, FRN, 1.88%, 24/11/2051	82	0,01
300.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.70%, 31/03/2026	297	0,04
700.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.15%, 22/01/2027	662	0,09
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.13%, 01/07/2027	188	0,03
300.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.13%, 02/12/2027	291	0,04
850.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.00%, 17/03/2028	818	0,11
450.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.50%, 18/04/2030	410	0,06
250.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 1.65%, 28/03/2031	226	0,03
150.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.45%, 22/09/2031	152	0,02
650.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.88%, 02/04/2032	632	0,09
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.25%, 24/01/2033	199	0,03
200.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.00%, 23/01/2035	176	0,03
680.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 2.75%, 17/03/2036	634	0,09
600.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.75%, 22/03/2037	615	0,09
400.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.70%, 02/04/2040	401	0,06
225.000	EUR	Anheuser-Busch InBev SA, 3.95%, 22/03/2044	230	0,03
500.000	EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.00%, 29/01/2027	460	0,07
300.000	EUR	Cofinimmo SA, REIT, 1.00%, 24/01/2028	271	0,04
100.000	EUR	Cofinimmo SA, REIT, 0.88%, 02/12/2030	81	0,01
100.000	EUR	Crelan SA, 5.75%, 26/01/2028	105	0,02
200.000	EUR	Crelan SA, FRN, 6.00%, 28/02/2030	214	0,03
300.000	EUR	Crelan SA, FRN, 5.25%, 23/01/2032	312	0,05
100.000	EUR	Elia Group SA, 1.50%, 05/09/2028	93	0,01
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 1.38%, 14/01/2026	96	0,01
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.25%, 04/04/2028	100	0,01
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.00%, 07/04/2029	98	0,01
100.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 0.88%, 28/04/2030	86	0,01
300.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.63%, 18/01/2033	305	0,04
200.000	EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.75%, 16/01/2036	202	0,03
100.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 3.13%, 06/09/2029	99	0,01
300.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 0.13%, 28/01/2031	242	0,03
200.000	EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 4.00%, 15/05/2033	209	0,03
300.000	EUR	KBC Group NV, 0.63%, 10/04/2025	291	0,04
100.000	EUR	KBC Group NV, 0.75%, 24/01/2030	86	0,01
200.000	EUR	KBC Group NV, 3.00%, 25/08/2030	194	0,03
400.000	EUR	KBC Group NV, 0.75%, 31/05/2031	336	0,05
200.000	EUR	KBC Group NV, 4.38%, 06/12/2031	212	0,03
100.000	EUR	KBC Group NV, 3.75%, 27/03/2032	101	0,01
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.50%, 06/06/2026	201	0,03
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.13%, 10/09/2026	190	0,03
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.25%, 01/03/2027	94	0,01
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.38%, 16/06/2027	93	0,01
400.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.38%, 23/11/2027	408	0,06
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.75%, 21/01/2028	185	0,03
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.13%, 14/01/2029	175	0,03
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.25%, 28/11/2029	102	0,02
300.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.38%, 19/04/2030	310	0,04
400.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.63%, 07/12/2031	366	0,05
100.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.88%, 25/04/2033	102	0,01
200.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 4.75%, 17/04/2035	203	0,03
150.000	EUR	Lonza Finance International NV, 1.63%, 21/04/2027	142	0,02
200.000	EUR	Lonza Finance International NV, 3.88%, 25/05/2033	205	0,03
100.000	EUR	Syensqo SA, FRN, 2.50%, 12/02/2025 ¹	96	0,01
100.000	EUR	Syensqo SA, FRN, 2.75%, 02/12/2027	98	0,01
300.000	EUR	VGP NV, REIT, 1.63%, 17/01/2027	278	0,04
100.000	EUR	VGP NV, REIT, 1.50%, 08/04/2029	84	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Belgien (Fortsetzung)				
100.000	EUR	VGP NV, REIT, 2.25%, 17/01/2030	85	0,01
		Belgien - Gesamt	13.970	1,95
Britische Jungferninseln (31. März 2023: 0,04 %)				
			–	–
Kanada (31. März 2023: 0,78 %)				
200.000	EUR	Bank of Montreal, 2.75%, 15/06/2027	196	0,03
200.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 0.13%, 04/09/2026	185	0,03
200.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 0.25%, 01/11/2028	175	0,02
200.000	EUR	Fairfax Financial Holdings Ltd., 2.75%, 29/03/2028	191	0,03
200.000	EUR	Great-West Lifeco, Inc., 1.75%, 07/12/2026	192	0,03
200.000	EUR	Great-West Lifeco, Inc., 4.70%, 16/11/2029	213	0,03
400.000	EUR	Magna International, Inc., 1.50%, 25/09/2027	376	0,05
100.000	EUR	Magna International, Inc., 4.38%, 17/03/2032	106	0,01
375.000	EUR	Mercedes-Benz Finance Canada, Inc., 3.00%, 23/02/2027	373	0,05
100.000	EUR	National Bank of Canada, 3.75%, 25/01/2028	101	0,01
200.000	EUR	Royal Bank of Canada, 4.13%, 05/07/2028	205	0,03
340.000	EUR	Royal Bank of Canada, 2.13%, 26/04/2029	320	0,04
200.000	EUR	Royal Bank of Canada, 4.38%, 02/10/2030	210	0,03
378.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.50%, 18/01/2027	350	0,05
200.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 2.55%, 03/08/2027	195	0,03
250.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 3.63%, 13/12/2029	253	0,04
350.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 1.95%, 08/04/2030	324	0,04
550.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 3.13%, 03/08/2032	539	0,08
300.000	EUR	TotalEnergies Capital Canada Ltd., 2.13%, 18/09/2029	283	0,04
		Kanada - Gesamt	4.787	0,67
Cayman-Inseln (31. März 2023: 0,15 %)				
125.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd., 1.25%, 13/04/2025	122	0,02
100.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd., 2.00%, 13/04/2030	91	0,01
100.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd., 0.75%, 02/11/2029	85	0,01
300.000	EUR	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd., 1.00%, 02/11/2033	236	0,03
422.000	EUR	CK Hutchison Finance 16 Ltd., 2.00%, 06/04/2028	397	0,06
		Cayman-Inseln - Gesamt	931	0,13
Kroatien (31. März 2023: 0,02 %)				
100.000	EUR	Erste&Steiermaerkische Banka dd, FRN, 0.75%, 06/07/2028	88	0,01
200.000	EUR	Raiffeisenbank Austria dd/Croatia, FRN, 7.88%, 05/06/2027	212	0,03
		Kroatien - Gesamt	300	0,04
Tschechische Republik (31. März 2023: 0,15 %)				
300.000	EUR	Ceska sporitelna A/S, FRN, 5.74%, 08/03/2028	310	0,04
100.000	EUR	Ceska sporitelna A/S, FRN, 0.50%, 13/09/2028	88	0,01
100.000	EUR	Ceska sporitelna A/S, FRN, 4.82%, 15/01/2030	101	0,02
150.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 1.70%, 30/07/2026	138	0,02
125.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 2.05%, 09/10/2028	109	0,02
300.000	EUR	EP Infrastructure A/S, 1.82%, 02/03/2031	238	0,03
100.000	EUR	Raiffeisenbank A/S, FRN, 1.00%, 09/06/2028	89	0,01
		Tschechische Republik - Gesamt	1.073	0,15
Dänemark (31. März 2023: 1,13 %)				
100.000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 1.75%, 16/03/2026	96	0,01
200.000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 0.75%, 25/11/2031	164	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Dänemark (Fortsetzung)				
250.000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 3.75%, 05/03/2032	253	0,03
125.000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 4.13%, 05/03/2036	127	0,02
200.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 3.25%, 12/10/2025	199	0,03
200.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 3.50%, 26/11/2026	201	0,03
100.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 0.38%, 30/06/2027	91	0,01
300.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 4.00%, 05/10/2028	308	0,04
150.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 0.88%, 01/07/2029	133	0,02
100.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 0.63%, 09/03/2030	86	0,01
200.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 4.25%, 05/10/2033	213	0,03
100.000	EUR	Danica Pension Livsforsikrings AB, FRN, 4.38%, 29/09/2045	100	0,01
200.000	EUR	Danske Bank AS, 0.63%, 26/05/2025	193	0,03
400.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 4.00%, 12/01/2027	402	0,06
200.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 1.38%, 17/02/2027	191	0,03
250.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 4.50%, 09/11/2028	256	0,04
100.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 0.75%, 09/06/2029	89	0,01
325.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 4.75%, 21/06/2030	340	0,05
100.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 1.50%, 02/09/2030	96	0,01
200.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 4.13%, 10/01/2031	206	0,03
125.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 1.00%, 15/05/2031	117	0,02
200.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 3.88%, 09/01/2032	201	0,03
200.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 4.63%, 14/05/2034	201	0,03
200.000	EUR	DSV A/S, 0.38%, 26/02/2027	183	0,03
150.000	EUR	H Lundbeck A/S, 0.88%, 14/10/2027	135	0,02
300.000	EUR	ISS Global A/S, 0.88%, 18/06/2026	282	0,04
125.000	EUR	ISS Global A/S, 1.50%, 31/08/2027	117	0,02
300.000	EUR	Jyske Bank A/S, 5.50%, 16/11/2027	312	0,04
200.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 4.63%, 11/04/2026	201	0,03
200.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.25%, 17/02/2028	182	0,03
300.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 4.88%, 10/11/2029	311	0,04
200.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 5.13%, 01/05/2035	204	0,03
150.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.50%, 10/07/2025	144	0,02
475.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.25%, 13/01/2026	447	0,06
300.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.75%, 20/01/2027	277	0,04
300.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 1.38%, 12/07/2027	280	0,04
350.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 0.38%, 17/01/2028	309	0,04
200.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 4.00%, 17/07/2028	202	0,03
200.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, 4.63%, 19/01/2029	207	0,03
100.000	EUR	Nykredit Realkredit A/S, FRN, 5.50%, 29/12/2032	103	0,01
300.000	EUR	Pandora A/S, FRN, 4.50%, 10/04/2028	310	0,04
100.000	EUR	Sydbank A/S, FRN, 0.50%, 10/11/2026	95	0,01
200.000	EUR	Sydbank A/S, FRN, 5.13%, 06/09/2028	207	0,03
100.000	EUR	TDC Net A/S, FRN, 5.06%, 31/05/2028	103	0,01
100.000	EUR	TDC Net A/S, FRN, 5.62%, 06/02/2030	103	0,01
200.000	EUR	TDC Net A/S, FRN, 6.50%, 01/06/2031	216	0,03
300.000	EUR	Vestas Wind Systems A/S, FRN, 4.13%, 15/06/2026	303	0,04
		Dänemark - Gesamt	9.496	1,32
Estland (31. März 2023: 0,03 %)				
150.000	EUR	Luminor Bank A/S, FRN, 0.54%, 23/09/2026	141	0,02
		Estland - Gesamt	141	0,02
Finnland (31. März 2023: 1,39 %)				
175.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 1.00%, 20/01/2029	143	0,02
100.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 1.38%, 24/05/2030	80	0,01
125.000	EUR	Balder Finland OYJ, REIT, 2.00%, 18/01/2031	102	0,02
100.000	EUR	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, REIT, 0.88%, 17/09/2029	81	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Finnland (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Elisa OYJ, 1.13%, 26/02/2026	95	0,01
100.000	EUR	Elisa OYJ, 0.25%, 15/09/2027	90	0,01
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 1.63%, 07/03/2025	98	0,01
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 2.00%, 31/03/2026	96	0,01
100.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 1.88%, 27/05/2027	92	0,01
150.000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 0.88%, 28/05/2029	124	0,02
100.000	EUR	Metso OYJ, 0.88%, 26/05/2028	90	0,01
100.000	EUR	Metso OYJ, FRN, 4.38%, 22/11/2030	103	0,01
100.000	EUR	Neste OYJ, 0.75%, 25/03/2028	90	0,01
200.000	EUR	Neste OYJ, 3.88%, 16/03/2029	204	0,03
200.000	EUR	Neste OYJ, 3.88%, 21/05/2031	205	0,03
100.000	EUR	Neste OYJ, 4.25%, 16/03/2033	106	0,02
300.000	EUR	Nokia OYJ, 2.00%, 11/03/2026	290	0,04
100.000	EUR	Nokia OYJ, 3.13%, 15/05/2028	98	0,01
100.000	EUR	Nokia OYJ, FRN, 4.38%, 21/08/2031	102	0,01
100.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.38%, 28/05/2026	94	0,01
300.000	EUR	Nordea Bank Abp, 1.13%, 16/02/2027	281	0,04
475.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 14/05/2027	438	0,06
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, 1.13%, 27/09/2027	188	0,03
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, 4.13%, 05/05/2028	205	0,03
175.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 02/11/2028	154	0,02
350.000	EUR	Nordea Bank Abp, 2.50%, 23/05/2029	334	0,05
100.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 19/03/2031	83	0,01
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, 2.88%, 24/08/2032	192	0,03
225.000	EUR	Nordea Bank Abp, 3.63%, 15/03/2034	226	0,03
400.000	EUR	Nordea Bank Abp, FRN, 4.38%, 06/09/2026	403	0,06
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, FRN, 0.63%, 18/08/2031	185	0,03
200.000	EUR	Nordea Bank Abp, FRN, 4.88%, 23/02/2034	207	0,03
200.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 1.00%, 22/05/2025	194	0,03
400.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.50%, 12/08/2025	383	0,05
300.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 2.88%, 15/12/2025	297	0,04
125.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.25%, 24/03/2026	117	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.60%, 18/01/2027	92	0,01
150.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 4.13%, 18/04/2027	153	0,02
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.63%, 27/07/2027	91	0,01
600.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.10%, 16/11/2027	536	0,08
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 16/06/2028	88	0,01
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 08/12/2028	87	0,01
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.63%, 12/11/2029	85	0,01
100.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.75%, 24/03/2031	85	0,01
225.000	EUR	OP Corporate Bank plc, FRN, 1.63%, 09/06/2030	218	0,03
300.000	EUR	Sampo OYJ, 1.63%, 21/02/2028	283	0,04
100.000	EUR	Sampo OYJ, 2.25%, 27/09/2030	94	0,01
150.000	EUR	Sampo OYJ, FRN, 3.38%, 23/05/2049	143	0,02
200.000	EUR	Sampo OYJ, FRN, 2.50%, 03/09/2052	173	0,02
100.000	EUR	SATO OYJ, REIT, 1.38%, 24/02/2028	89	0,01
250.000	EUR	Stora Enso OYJ, 4.00%, 01/06/2026	251	0,04
300.000	EUR	Stora Enso OYJ, 4.25%, 01/09/2029	307	0,04
200.000	EUR	Stora Enso OYJ, 0.63%, 02/12/2030	163	0,02
100.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 2.13%, 04/02/2025	98	0,02
200.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 1.13%, 09/03/2026	189	0,03
250.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 2.63%, 31/03/2027	241	0,04
150.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 1.38%, 23/06/2028	136	0,02
200.000	EUR	Teollisuuden Voima OYJ, 4.75%, 01/06/2030	209	0,03
200.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 0.13%, 19/11/2028	173	0,03
100.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 2.25%, 23/05/2029	95	0,01
150.000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 0.50%, 22/03/2031	124	0,02
Finnland - Gesamt			10.473	1,46

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (31. März 2023: 20,61 %)				
100.000	EUR	Accor SA, 3.88%, 11/03/2031	101	0,01
200.000	EUR	Accor SA, FRN, 1.75%, 04/02/2026	193	0,03
200.000	EUR	Accor SA, FRN, 2.38%, 29/11/2028	190	0,03
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.00%, 02/04/2025	97	0,01
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.00%, 08/03/2027	94	0,01
300.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.25%, 13/06/2028	279	0,04
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 1.38%, 02/04/2030	91	0,01
400.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.63%, 20/06/2030	345	0,05
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.38%, 27/05/2031	83	0,01
300.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 2.88%, 16/09/2032	295	0,04
100.000	EUR	Air Liquide Finance SA, 0.38%, 20/09/2033	78	0,01
300.000	EUR	ALD SA, 4.75%, 13/10/2025	304	0,04
100.000	EUR	ALD SA, 1.25%, 02/03/2026	95	0,01
400.000	EUR	ALD SA, 4.25%, 18/01/2027	406	0,06
400.000	EUR	ALD SA, 3.88%, 22/02/2027	402	0,06
100.000	EUR	ALD SA, 4.00%, 05/07/2027	101	0,01
300.000	EUR	ALD SA, 3.88%, 24/01/2028	302	0,04
300.000	EUR	ALD SA, 4.88%, 06/10/2028	314	0,04
300.000	EUR	ALD SA, 4.00%, 24/01/2031	305	0,04
200.000	EUR	Alstom SA, 0.25%, 14/10/2026	184	0,03
100.000	EUR	Alstom SA, 0.13%, 27/07/2027	89	0,01
200.000	EUR	Alstom SA, 0.00%, 11/01/2029	164	0,02
400.000	EUR	Alstom SA, 0.50%, 27/07/2030	324	0,05
100.000	EUR	Altarea SCA, REIT, 1.75%, 16/01/2030	80	0,01
200.000	EUR	APRR SA, 1.25%, 14/01/2027	190	0,03
400.000	EUR	APRR SA, 1.25%, 18/01/2028	372	0,05
100.000	EUR	APRR SA, 0.00%, 19/06/2028	87	0,01
100.000	EUR	APRR SA, 1.88%, 03/01/2029	94	0,01
100.000	EUR	APRR SA, 0.13%, 18/01/2029	87	0,01
300.000	EUR	APRR SA, 3.13%, 24/01/2030	298	0,04
100.000	EUR	APRR SA, 1.50%, 25/01/2030	91	0,01
200.000	EUR	APRR SA, 1.88%, 06/01/2031	184	0,03
100.000	EUR	APRR SA, 1.63%, 13/01/2032	89	0,01
100.000	EUR	APRR SA, 1.50%, 17/01/2033	86	0,01
300.000	EUR	APRR SA, FRN, 1.13%, 09/01/2026	288	0,04
200.000	EUR	Arkema SA, 1.50%, 20/01/2025	196	0,03
300.000	EUR	Arkema SA, 0.13%, 14/10/2026	277	0,04
200.000	EUR	Arkema SA, 1.50%, 20/04/2027	190	0,03
300.000	EUR	Arkema SA, 0.75%, 03/12/2029	261	0,04
100.000	EUR	Arkema SA, 4.25%, 20/05/2030	104	0,02
100.000	EUR	Arkema SA, 3.50%, 23/01/2031	100	0,01
200.000	EUR	Arval Service Lease SA, 0.88%, 17/02/2025	195	0,03
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.25%, 11/11/2025	101	0,01
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 3.38%, 04/01/2026	99	0,01
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.13%, 13/04/2026	101	0,01
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.00%, 22/09/2026	302	0,04
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.75%, 22/05/2027	310	0,04
100.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.13%, 20/04/2026	96	0,01
200.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.00%, 13/05/2026	190	0,03
300.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.25%, 18/01/2027	285	0,04
100.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.38%, 27/06/2028	93	0,01
200.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.38%, 22/01/2030	181	0,03
300.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.38%, 21/02/2031	265	0,04
200.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 2.75%, 02/09/2032	193	0,03
200.000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 3.25%, 19/01/2033	199	0,03
100.000	EUR	AXA SA, 1.13%, 15/05/2028	93	0,01
100.000	EUR	AXA SA, 3.75%, 12/10/2030	104	0,02
300.000	EUR	AXA SA, 3.63%, 10/01/2033	311	0,04
150.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.88%, 10/08/2025 ¹	149	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
350.000	EUR	AXA SA, FRN, 1.38%, 07/10/2041	292	0,04
550.000	EUR	AXA SA, FRN, 1.88%, 10/07/2042	463	0,07
275.000	EUR	AXA SA, FRN, 4.25%, 10/03/2043	275	0,04
100.000	EUR	AXA SA, FRN, 5.50%, 11/07/2043	109	0,02
440.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.38%, 06/07/2047	431	0,06
575.000	EUR	AXA SA, FRN, 3.25%, 28/05/2049	551	0,08
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.00%, 23/05/2025	485	0,07
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 17/07/2025	96	0,01
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.00%, 11/09/2025	197	0,03
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.63%, 19/01/2026	387	0,05
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.38%, 24/03/2026	194	0,03
800.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 11/05/2026	744	0,10
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 08/06/2026	377	0,05
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.88%, 04/11/2026	95	0,01
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.63%, 31/03/2027	97	0,01
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 26/05/2027	281	0,04
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.13%, 14/09/2027	495	0,07
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.10%, 08/10/2027	179	0,03
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.63%, 15/11/2027	93	0,01
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 19/11/2027	90	0,01
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.88%, 26/01/2028	202	0,03
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.88%, 14/02/2028	509	0,07
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.50%, 25/05/2028	191	0,03
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.25%, 29/06/2028	88	0,01
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.38%, 16/07/2028	462	0,07
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.25%, 19/07/2028	260	0,04
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 03/11/2028	350	0,05
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 13/03/2029	413	0,06
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.75%, 15/03/2029	183	0,03
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.88%, 18/06/2029	273	0,04
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.63%, 06/11/2029	285	0,04
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.00%, 21/11/2029	103	0,01
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.75%, 17/01/2030	339	0,05
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.38%, 02/05/2030	415	0,06
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 03/06/2030	174	0,02
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 18/09/2030	313	0,04
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.63%, 21/02/2031	164	0,02
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.75%, 10/11/2031	319	0,05
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.13%, 19/11/2031	81	0,01
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.13%, 19/01/2032	251	0,04
100.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.63%, 14/09/2032	101	0,01
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.13%, 13/01/2033	320	0,05
200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.00%, 26/01/2033	205	0,03
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.75%, 01/02/2033	307	0,04
400.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 14/06/2033	420	0,06
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.38%, 11/01/2034	497	0,07
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.75%, 03/02/2034	304	0,04
300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 3.88%, 16/06/2032	297	0,04
300.000	EUR	Banque Stellantis France SACA, 3.88%, 19/01/2026	301	0,04
100.000	EUR	Banque Stellantis France SACA, 3.50%, 19/07/2027	100	0,01
200.000	EUR	BNP Paribas Cardif SA, FRN, 4.03%, 25/11/2025 ¹	198	0,03
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.50%, 17/11/2025	290	0,04
150.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.75%, 27/01/2026	147	0,02
250.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.63%, 23/02/2026	242	0,03
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.13%, 11/06/2026	190	0,03
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.13%, 04/09/2026	185	0,03
100.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.88%, 01/10/2026	98	0,01
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.25%, 11/01/2027	289	0,04
440.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.50%, 23/05/2028	409	0,06

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.50%, 25/05/2028	186	0,03
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.38%, 28/05/2029	270	0,04
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 3.63%, 01/09/2029	300	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.63%, 02/07/2031	171	0,02
300.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.10%, 07/04/2032	268	0,04
400.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.63%, 03/12/2032	310	0,04
200.000	EUR	BNP Paribas SA, 4.13%, 24/05/2033	211	0,03
500.000	EUR	BNP Paribas SA, 4.10%, 13/02/2034	512	0,07
800.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	777	0,11
100.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.25%, 13/04/2027	93	0,01
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.38%, 14/10/2027	185	0,03
400.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 19/02/2028	366	0,05
100.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 30/05/2028	91	0,01
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.75%, 25/07/2028	194	0,03
500.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 01/09/2028	449	0,07
500.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 4.38%, 13/01/2029	514	0,07
400.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 3.88%, 23/02/2029	407	0,06
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 1.13%, 17/04/2029	272	0,04
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 19/01/2030	258	0,03
400.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.88%, 11/07/2030	347	0,05
300.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.38%, 20/11/2030	292	0,04
500.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 3.88%, 10/01/2031	512	0,07
400.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 4.25%, 13/04/2031	415	0,06
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 4.04%, 10/01/2032	203	0,03
400.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 1.13%, 15/01/2032	367	0,05
600.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.50%, 31/03/2032	570	0,08
500.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 4.13%, 26/09/2032	521	0,07
500.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 4.75%, 13/11/2032	531	0,07
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.88%, 31/08/2033	173	0,02
100.000	EUR	Bouygues SA, 1.38%, 07/06/2027	94	0,01
200.000	EUR	Bouygues SA, 1.13%, 24/07/2028	184	0,03
500.000	EUR	Bouygues SA, 2.25%, 29/06/2029	476	0,07
200.000	EUR	Bouygues SA, 0.50%, 11/02/2030	172	0,02
600.000	EUR	Bouygues SA, 3.88%, 17/07/2031	619	0,09
300.000	EUR	Bouygues SA, 4.63%, 07/06/2032	325	0,05
400.000	EUR	Bouygues SA, 3.25%, 30/06/2037	388	0,05
200.000	EUR	Bouygues SA, 5.38%, 30/06/2042	237	0,03
100.000	EUR	BPCE SA, 0.13%, 04/12/2024	98	0,01
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 01/04/2025	195	0,03
400.000	EUR	BPCE SA, 0.63%, 28/04/2025	387	0,05
300.000	EUR	BPCE SA, 0.38%, 02/02/2026	283	0,04
200.000	EUR	BPCE SA, 1.38%, 23/03/2026	191	0,03
300.000	EUR	BPCE SA, 3.63%, 17/04/2026	301	0,04
400.000	EUR	BPCE SA, 2.88%, 22/04/2026	392	0,06
200.000	EUR	BPCE SA, 0.01%, 14/01/2027	182	0,03
200.000	EUR	BPCE SA, 0.50%, 24/02/2027	183	0,03
300.000	EUR	BPCE SA, 1.75%, 26/04/2027	286	0,04
300.000	EUR	BPCE SA, 3.50%, 25/01/2028	301	0,04
100.000	EUR	BPCE SA, 1.63%, 31/01/2028	93	0,01
100.000	EUR	BPCE SA, 4.13%, 10/07/2028	103	0,01
400.000	EUR	BPCE SA, 4.38%, 13/07/2028	410	0,06
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 05/10/2028	180	0,03
300.000	EUR	BPCE SA, 3.88%, 11/01/2029	301	0,04
100.000	EUR	BPCE SA, 0.63%, 15/01/2030	86	0,01
400.000	EUR	BPCE SA, 0.25%, 14/01/2031	325	0,05
200.000	EUR	BPCE SA, 0.75%, 03/03/2031	166	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, 1.00%, 14/01/2032	165	0,02
200.000	EUR	BPCE SA, 2.38%, 26/04/2032	185	0,03
400.000	EUR	BPCE SA, 4.00%, 29/11/2032	417	0,06

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
500.000	EUR	BPCE SA, 4.50%, 13/01/2033	526	0,07
300.000	EUR	BPCE SA, 3.88%, 25/01/2036	305	0,04
600.000	EUR	BPCE SA, FRN, 0.50%, 15/09/2027	555	0,08
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 0.50%, 14/01/2028	91	0,01
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 1.63%, 02/03/2029	92	0,01
300.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.63%, 02/03/2030	312	0,04
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 2.25%, 02/03/2032	94	0,01
400.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.13%, 08/03/2033	406	0,06
200.000	EUR	BPCE SA, FRN, 5.75%, 01/06/2033	212	0,03
200.000	EUR	BPCE SA, FRN, 1.75%, 02/02/2034	178	0,03
300.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.75%, 14/06/2034	321	0,05
300.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.25%, 11/01/2035	309	0,04
300.000	EUR	BPCE SA, FRN, 5.13%, 25/01/2035	310	0,04
100.000	EUR	BPCE SA, FRN, 4.88%, 26/02/2036	102	0,01
400.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 6.00%, 23/01/2027	424	0,06
200.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 0.75%, 07/07/2028	177	0,03
100.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 3.38%, 24/09/2028	99	0,01
300.000	EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 2.13%, 16/09/2029	275	0,04
200.000	EUR	Capgemini SE, 0.63%, 23/06/2025	193	0,03
200.000	EUR	Capgemini SE, 1.63%, 15/04/2026	193	0,03
100.000	EUR	Capgemini SE, 1.75%, 18/04/2028	94	0,01
400.000	EUR	Capgemini SE, 2.00%, 15/04/2029	378	0,05
200.000	EUR	Capgemini SE, 1.13%, 23/06/2030	177	0,03
400.000	EUR	Capgemini SE, 2.38%, 15/04/2032	374	0,05
100.000	EUR	Carmila SA, REIT, 1.63%, 30/05/2027	93	0,01
200.000	EUR	Carmila SA, REIT, 1.63%, 01/04/2029	178	0,03
100.000	EUR	Carrefour Banque SA, 0.11%, 14/06/2025	96	0,01
200.000	EUR	Carrefour Banque SA, 4.08%, 05/05/2027	201	0,03
100.000	EUR	Carrefour SA, 1.75%, 04/05/2026	97	0,01
100.000	EUR	Carrefour SA, 1.00%, 17/05/2027	93	0,01
200.000	EUR	Carrefour SA, 2.63%, 15/12/2027	195	0,03
250.000	EUR	Carrefour SA, FRN, 1.25%, 03/06/2025	244	0,03
300.000	EUR	Carrefour SA, FRN, 1.88%, 30/10/2026	289	0,04
400.000	EUR	Carrefour SA, FRN, 4.13%, 12/10/2028	413	0,06
200.000	EUR	Carrefour SA, FRN, 2.38%, 30/10/2029	190	0,03
100.000	EUR	Carrefour SA, FRN, 3.75%, 10/10/2030	102	0,01
200.000	EUR	Carrefour SA, FRN, 4.38%, 14/11/2031	210	0,03
300.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.00%, 17/03/2025	293	0,04
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.63%, 10/08/2025	97	0,01
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.13%, 23/03/2026	191	0,03
400.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.75%, 29/11/2026	403	0,06
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.38%, 14/06/2027	188	0,03
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.38%, 04/10/2027	194	0,03
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.13%, 10/06/2028	96	0,01
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.88%, 21/09/2028	94	0,01
300.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.50%, 18/01/2029	301	0,04
200.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.88%, 29/11/2030	204	0,03
500.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.88%, 15/03/2031	452	0,06
400.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.63%, 08/04/2034	402	0,06
100.000	EUR	Cie de Saint-Gobain SA, FRN, 2.63%, 10/08/2032	95	0,01
100.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 1.75%, 28/05/2027	97	0,01
500.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.00%, 02/11/2028	436	0,06
300.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 1.75%, 03/09/2030	277	0,04
100.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.25%, 02/11/2032	79	0,01
200.000	EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 2.50%, 03/09/2038	188	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Coface SA, 6.00%, 22/09/2032	110	0,02
100.000	EUR	Coface SA, 5.75%, 28/11/2033	108	0,02
200.000	EUR	Cofiroute SA, 1.13%, 13/10/2027	187	0,03
200.000	EUR	Cofiroute SA, 0.75%, 09/09/2028	180	0,03
400.000	EUR	Cofiroute SA, 1.00%, 19/05/2031	343	0,05
200.000	EUR	Covivio SA, REIT, 1.50%, 21/06/2027	187	0,03
200.000	EUR	Covivio SA, REIT, 2.38%, 20/02/2028	192	0,03
300.000	EUR	Covivio SA, REIT, 1.63%, 23/06/2030	265	0,04
200.000	EUR	Covivio SA, REIT, 1.13%, 17/09/2031	166	0,02
100.000	EUR	Covivio SA, REIT, 4.63%, 05/06/2032	104	0,02
300.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, 2.00%, 17/07/2030	265	0,04
400.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, 1.50%, 06/10/2031	333	0,05
100.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, 5.88%, 25/10/2033	112	0,02
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 4.50%, 14/10/2025 ¹	200	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 2.63%, 29/01/2048	188	0,03
500.000	EUR	Credit Agricole Assurances SA, FRN, 4.75%, 27/09/2048	510	0,07
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.38%, 13/03/2025	294	0,04
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.00%, 18/09/2025	386	0,05
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.38%, 21/10/2025	381	0,05
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.13%, 05/02/2026	199	0,03
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.25%, 14/04/2026	287	0,04
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.88%, 20/12/2026	288	0,04
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.63%, 17/03/2027	387	0,05
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.38%, 03/05/2027	189	0,03
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.38%, 28/07/2027	401	0,06
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.13%, 09/12/2027	178	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.38%, 20/04/2028	177	0,03
100.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.13%, 24/02/2029	91	0,01
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.75%, 05/03/2029	369	0,05
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.00%, 25/03/2029	184	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.00%, 03/07/2029	178	0,03
500.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.50%, 29/08/2029	480	0,07
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.13%, 07/03/2030	313	0,04
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.88%, 20/04/2031	413	0,06
500.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.88%, 14/01/2032	410	0,06
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.13%, 12/07/2032	168	0,02
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.00%, 18/01/2033	210	0,03
300.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.38%, 27/11/2033	317	0,04
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.75%, 22/01/2034	409	0,06
200.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.50%, 22/04/2034	184	0,03
500.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.88%, 28/11/2034	519	0,07
400.000	EUR	Credit Agricole SA, 4.13%, 26/02/2036	412	0,06
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.00%, 22/04/2026	194	0,03
300.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 4.00%, 12/10/2026	301	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.88%, 22/04/2027	193	0,03
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 0.63%, 12/01/2028	184	0,03
400.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 4.25%, 11/07/2029	410	0,06
300.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 0.50%, 21/09/2029	263	0,04
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.63%, 05/06/2030	194	0,03
300.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 5.50%, 28/08/2033	316	0,04
100.000	EUR	Credit Logement SA, FRN, 1.08%, 15/02/2034	87	0,01
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.01%, 28/01/2026	188	0,03
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.63%, 15/04/2026	193	0,03
300.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.25%, 01/06/2026	297	0,04
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 07/05/2027	92	0,01
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.38%, 19/09/2027	200	0,03
300.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.88%, 22/05/2028	305	0,04
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.38%, 03/10/2028	88	0,01
300.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.50%, 09/02/2029	293	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.13%, 23/05/2029	90	0,01
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.75%, 18/01/2030	86	0,01
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.38%, 11/03/2031	95	0,01
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 4.13%, 02/04/2031	208	0,03
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 25/10/2031	165	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 4.25%, 01/12/2032	105	0,02
100.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.88%, 11/03/2033	80	0,01
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.63%, 03/10/2033	202	0,03
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 4.13%, 01/02/2034	210	0,03
200.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, FRN, 1.25%, 11/06/2029	182	0,02
100.000	EUR	Danone SA, 1.13%, 14/01/2025	98	0,01
200.000	EUR	Danone SA, 1.00%, 26/03/2025	195	0,03
100.000	EUR	Danone SA, 0.00%, 01/12/2025	95	0,01
400.000	EUR	Danone SA, 0.57%, 17/03/2027	373	0,05
200.000	EUR	Danone SA, 1.21%, 03/11/2028	184	0,03
200.000	EUR	Danone SA, 0.40%, 10/06/2029	174	0,02
500.000	EUR	Danone SA, 3.71%, 13/11/2029	512	0,07
100.000	EUR	Danone SA, 0.52%, 09/11/2030	84	0,01
300.000	EUR	Danone SA, 3.47%, 22/05/2031	305	0,04
200.000	EUR	Danone SA, 3.07%, 07/09/2032	197	0,03
100.000	EUR	Danone SA, FRN, 1.00%, 16/09/2026 ¹	92	0,01
100.000	EUR	Edenred SE, 1.38%, 10/03/2025	98	0,01
100.000	EUR	Edenred SE, 1.88%, 06/03/2026	97	0,01
100.000	EUR	Edenred SE, 3.63%, 13/12/2026	100	0,01
100.000	EUR	Edenred SE, 1.88%, 30/03/2027	96	0,01
100.000	EUR	Edenred SE, 1.38%, 18/06/2029	90	0,01
300.000	EUR	Edenred SE, 3.63%, 13/06/2031	303	0,04
200.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 27/03/2025	196	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 0.88%, 19/09/2025	96	0,01
100.000	EUR	Engie SA, 1.00%, 13/03/2026	96	0,01
100.000	EUR	Engie SA, 2.38%, 19/05/2026	98	0,01
300.000	EUR	Engie SA, 3.63%, 06/12/2026	301	0,04
100.000	EUR	Engie SA, 0.00%, 04/03/2027	91	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 11/06/2027	182	0,03
300.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 21/06/2027	273	0,04
300.000	EUR	Engie SA, 3.75%, 06/09/2027	304	0,04
200.000	EUR	Engie SA, 1.50%, 27/03/2028	187	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 1.75%, 27/03/2028	94	0,01
100.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 22/06/2028	92	0,01
400.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 28/02/2029	366	0,05
100.000	EUR	Engie SA, 3.50%, 27/09/2029	101	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 0.38%, 26/10/2029	171	0,02
300.000	EUR	Engie SA, 3.63%, 11/01/2030	304	0,04
200.000	EUR	Engie SA, 0.50%, 24/10/2030	167	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 3.88%, 06/01/2031	102	0,01
100.000	EUR	Engie SA, 3.63%, 06/03/2031	101	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 2.13%, 30/03/2032	182	0,03
100.000	EUR	Engie SA, 1.88%, 19/09/2033	87	0,01
300.000	EUR	Engie SA, 3.88%, 06/12/2033	308	0,04
100.000	EUR	Engie SA, 4.25%, 06/09/2034	105	0,02
600.000	EUR	Engie SA, 4.00%, 11/01/2035	618	0,09
100.000	EUR	Engie SA, 1.50%, 13/03/2035	81	0,01
100.000	EUR	Engie SA, 3.88%, 06/03/2036	102	0,01
100.000	EUR	Engie SA, 1.00%, 26/10/2036	74	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 2.00%, 28/09/2037	164	0,02
100.000	EUR	Engie SA, 1.38%, 21/06/2039	72	0,01
200.000	EUR	Engie SA, 1.25%, 24/10/2041	133	0,02
300.000	EUR	Engie SA, 4.50%, 06/09/2042	319	0,05
200.000	EUR	Engie SA, 4.25%, 11/01/2043	206	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Engie SA, 4.25%, 06/03/2044	207	0,03
45.000	EUR	Engie SA, 5.95%, 16/03/2111	57	0,01
100.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.63%, 04/08/2025 ¹	97	0,01
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.50%, 30/05/2028 ¹	177	0,03
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.88%, 01/02/2031 ¹	167	0,02
200.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.13%, 27/05/2025	192	0,03
400.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.38%, 05/01/2026	380	0,05
300.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.38%, 27/11/2027	273	0,04
400.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.50%, 05/06/2028	362	0,05
200.000	EUR	EssilorLuxottica SA, 0.75%, 27/11/2031	170	0,02
200.000	EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.38%, 30/10/2026	191	0,03
200.000	EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.75%, 30/04/2030	183	0,03
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.50%, 20/01/2025	98	0,01
200.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.38%, 30/06/2027	188	0,03
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.38%, 26/01/2028	93	0,01
200.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.00%, 30/01/2029	179	0,03
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.63%, 14/03/2030	91	0,01
400.000	EUR	Gecina SA, REIT, 2.00%, 30/06/2032	362	0,05
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 0.88%, 25/01/2033	81	0,01
300.000	EUR	Gecina SA, REIT, 1.63%, 29/05/2034	255	0,04
100.000	EUR	Gecina SA, REIT, 0.88%, 30/06/2036	74	0,01
200.000	EUR	Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR, FRN, 1.85%, 21/04/2042	164	0,02
200.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.50%, 04/05/2027	194	0,03
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.63%, 27/11/2027	94	0,01
400.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 0.63%, 14/09/2028	353	0,05
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.63%, 18/09/2029	90	0,01
100.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 4.25%, 18/03/2030	103	0,01
300.000	EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.48%, 18/01/2031	260	0,04
200.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.10%, 03/09/2027	179	0,03
300.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 1.38%, 04/09/2028	277	0,04
200.000	EUR	Icade, REIT, 1.13%, 17/11/2025	191	0,03
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.75%, 10/06/2026	96	0,01
100.000	EUR	Icade, REIT, 1.50%, 13/09/2027	93	0,01
200.000	EUR	Icade, REIT, 1.63%, 28/02/2028	184	0,03
300.000	EUR	Icade, REIT, 1.00%, 19/01/2030	253	0,04
100.000	EUR	Icade, REIT, 0.63%, 18/01/2031	79	0,01
100.000	EUR	Imerys SA, FRN, 1.50%, 15/01/2027	94	0,01
200.000	EUR	Imerys SA, FRN, 1.88%, 31/03/2028	185	0,03
100.000	EUR	Imerys SA, FRN, 4.75%, 29/11/2029	103	0,01
100.000	EUR	Imerys SA, FRN, 1.00%, 15/07/2031	81	0,01
300.000	EUR	Indigo Group SAS, REIT, 4.50%, 18/04/2030	312	0,04
300.000	EUR	In'li SA, REIT, 1.13%, 02/07/2029	263	0,04
100.000	EUR	JCDecaux SE, 2.63%, 24/04/2028	97	0,01
400.000	EUR	JCDecaux SE, 5.00%, 11/01/2029	421	0,06
100.000	EUR	JCDecaux SE, 1.63%, 07/02/2030	88	0,01
100.000	EUR	Kering SA, 1.25%, 05/05/2025	97	0,01
200.000	EUR	Kering SA, 3.75%, 05/09/2025	201	0,03
100.000	EUR	Kering SA, 1.25%, 10/05/2026	96	0,01
100.000	EUR	Kering SA, 1.50%, 05/04/2027	95	0,01
200.000	EUR	Kering SA, 3.63%, 05/09/2027	202	0,03
100.000	EUR	Kering SA, 0.75%, 13/05/2028	91	0,01
300.000	EUR	Kering SA, 3.25%, 27/02/2029	300	0,04
200.000	EUR	Kering SA, 1.88%, 05/05/2030	185	0,03
300.000	EUR	Kering SA, 3.63%, 05/09/2031	306	0,04
300.000	EUR	Kering SA, 3.38%, 11/03/2032	301	0,04
200.000	EUR	Kering SA, 3.38%, 27/02/2033	199	0,03
400.000	EUR	Kering SA, 3.88%, 05/09/2035	412	0,06
300.000	EUR	Kering SA, 3.63%, 11/03/2036	301	0,04
300.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 1.38%, 16/02/2027	283	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 2.00%, 12/05/2029	186	0,03
200.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 0.63%, 01/07/2030	167	0,02
100.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 0.88%, 17/02/2031	84	0,01
100.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 1.25%, 29/09/2031	85	0,01
200.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 1.63%, 13/12/2032	170	0,02
300.000	EUR	Klepierre SA, REIT, 3.88%, 23/09/2033	300	0,04
300.000	EUR	La Mondiale SAM, 0.75%, 20/04/2026	282	0,04
200.000	EUR	La Mondiale SAM, 2.13%, 23/06/2031	177	0,03
300.000	EUR	Legrand SA, 1.00%, 06/03/2026	288	0,04
300.000	EUR	Legrand SA, 0.63%, 24/06/2028	272	0,04
100.000	EUR	Legrand SA, 0.75%, 20/05/2030	87	0,01
100.000	EUR	Legrand SA, 1.88%, 06/07/2032	92	0,01
300.000	EUR	Legrand SA, FRN, 3.50%, 29/05/2029	305	0,04
100.000	EUR	Legrand SA, FRN, 0.38%, 06/10/2031	83	0,01
100.000	EUR	L'Oreal SA, 3.13%, 19/05/2025	100	0,01
500.000	EUR	L'Oreal SA, 3.38%, 23/01/2027	504	0,07
300.000	EUR	L'Oreal SA, 2.88%, 19/05/2028	299	0,04
200.000	EUR	L'Oreal SA, 3.38%, 23/11/2029	205	0,03
400.000	EUR	L'Oreal SA, FRN, 0.88%, 29/06/2026	381	0,05
400.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.75%, 07/04/2025	389	0,05
100.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.38%, 21/10/2025	100	0,01
500.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.00%, 11/02/2026	472	0,07
400.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.13%, 11/02/2028	360	0,05
200.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.25%, 07/09/2029	202	0,03
600.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.38%, 11/02/2031	507	0,07
400.000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.50%, 07/09/2033	413	0,06
100.000	EUR	Mercialys SA, REIT, 1.80%, 27/02/2026	96	0,01
100.000	EUR	Mercialys SA, REIT, 2.50%, 28/02/2029	94	0,01
100.000	EUR	Nerval SAS, REIT, 3.63%, 20/07/2028	99	0,01
200.000	EUR	Nerval SAS, REIT, 2.88%, 14/04/2032	182	0,03
200.000	EUR	Orange SA, 1.00%, 12/05/2025	194	0,03
300.000	EUR	Orange SA, 1.00%, 12/09/2025	290	0,04
300.000	EUR	Orange SA, 0.00%, 29/06/2026	279	0,04
300.000	EUR	Orange SA, 0.00%, 04/09/2026	277	0,04
100.000	EUR	Orange SA, 0.88%, 03/02/2027	94	0,01
200.000	EUR	Orange SA, 1.25%, 07/07/2027	188	0,03
200.000	EUR	Orange SA, 1.50%, 09/09/2027	189	0,03
300.000	EUR	Orange SA, 1.38%, 20/03/2028	280	0,04
200.000	EUR	Orange SA, 2.00%, 15/01/2029	190	0,03
100.000	EUR	Orange SA, 0.13%, 16/09/2029	85	0,01
200.000	EUR	Orange SA, 1.38%, 16/01/2030	181	0,03
200.000	EUR	Orange SA, 1.88%, 12/09/2030	185	0,03
200.000	EUR	Orange SA, 3.63%, 16/11/2031	205	0,03
200.000	EUR	Orange SA, 1.63%, 07/04/2032	178	0,03
100.000	EUR	Orange SA, 2.38%, 18/05/2032	94	0,01
200.000	EUR	Orange SA, 0.50%, 04/09/2032	160	0,02
300.000	EUR	Orange SA, 8.13%, 28/01/2033	410	0,06
300.000	EUR	Orange SA, 0.63%, 16/12/2033	235	0,03
300.000	EUR	Orange SA, 0.75%, 29/06/2034	235	0,03
300.000	EUR	Orange SA, 1.20%, 11/07/2034	242	0,03
200.000	EUR	Orange SA, 1.38%, 04/09/2049	141	0,02
200.000	EUR	Orange SA, FRN, 2.38%, 15/01/2025 ¹	196	0,03
500.000	EUR	Orange SA, FRN, 5.00%, 10/01/2026 ¹	510	0,07
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.75%, 19/12/2026 ¹	93	0,01
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.75%, 15/07/2028 ¹	89	0,01
200.000	EUR	Orange SA, FRN, 1.38%, 02/11/2029 ¹	172	0,02
300.000	EUR	Orange SA, FRN, 5.38%, 18/01/2030 ¹	312	0,04
200.000	EUR	Orange SA, FRN, 4.50%, 15/12/2030 ¹	199	0,03
100.000	EUR	Orange SA, FRN, 3.88%, 11/09/2035	105	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 1.13%, 07/04/2025	195	0,03
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 3.75%, 15/09/2027	102	0,01
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.50%, 24/10/2027	183	0,03
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.13%, 04/10/2029	85	0,01
400.000	EUR	Pernod Ricard SA, 1.75%, 08/04/2030	368	0,05
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, 0.88%, 24/10/2031	84	0,01
200.000	EUR	Pernod Ricard SA, 3.75%, 15/09/2033	206	0,03
100.000	EUR	Pernod Ricard SA, FRN, 3.25%, 02/11/2028	100	0,01
400.000	EUR	Pernod Ricard SA, FRN, 1.38%, 07/04/2029	367	0,05
400.000	EUR	Pernod Ricard SA, FRN, 3.75%, 02/11/2032	411	0,06
100.000	EUR	PSA Tresorerie GIE, 6.00%, 19/09/2033	118	0,02
425.000	EUR	RCI Banque SA, 0.50%, 14/07/2025	407	0,06
325.000	EUR	RCI Banque SA, 4.13%, 01/12/2025	326	0,05
100.000	EUR	RCI Banque SA, 1.75%, 10/04/2026	96	0,01
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.63%, 26/05/2026	191	0,03
150.000	EUR	RCI Banque SA, 4.63%, 13/07/2026	152	0,02
200.000	EUR	RCI Banque SA, 4.63%, 02/10/2026	204	0,03
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.13%, 15/01/2027	187	0,03
200.000	EUR	RCI Banque SA, 4.50%, 06/04/2027	204	0,03
375.000	EUR	RCI Banque SA, 4.75%, 06/07/2027	386	0,05
125.000	EUR	RCI Banque SA, 3.75%, 04/10/2027	125	0,02
300.000	EUR	RCI Banque SA, 4.88%, 14/06/2028	312	0,04
100.000	EUR	RCI Banque SA, 4.88%, 21/09/2028	104	0,02
100.000	EUR	RCI Banque SA, 3.88%, 12/01/2029	100	0,01
100.000	EUR	RCI Banque SA, 4.88%, 02/10/2029	105	0,02
150.000	EUR	RCI Banque SA, 4.13%, 04/04/2031	151	0,02
400.000	EUR	SANEF SA, 1.88%, 16/03/2026	388	0,05
400.000	EUR	Sanofi SA, 1.00%, 01/04/2025	390	0,06
100.000	EUR	Sanofi SA, 1.50%, 22/09/2025	97	0,01
300.000	EUR	Sanofi SA, 1.00%, 21/03/2026	287	0,04
500.000	EUR	Sanofi SA, 1.75%, 10/09/2026	484	0,07
400.000	EUR	Sanofi SA, 0.50%, 13/01/2027	373	0,05
400.000	EUR	Sanofi SA, 1.13%, 05/04/2028	371	0,05
100.000	EUR	Sanofi SA, 0.88%, 21/03/2029	91	0,01
700.000	EUR	Sanofi SA, 1.38%, 21/03/2030	638	0,09
200.000	EUR	Sanofi SA, 1.50%, 01/04/2030	184	0,03
100.000	EUR	Sanofi SA, 1.25%, 21/03/2034	86	0,01
400.000	EUR	Sanofi SA, 1.88%, 21/03/2038	345	0,05
200.000	EUR	Sanofi SA, FRN, 1.25%, 06/04/2029	184	0,03
400.000	EUR	Schlumberger Finance France SAS, 1.00%, 18/02/2026	382	0,05
500.000	EUR	Schneider Electric SE, 0.88%, 13/12/2026	473	0,07
400.000	EUR	Schneider Electric SE, 1.38%, 21/06/2027	379	0,05
100.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.25%, 09/11/2027	100	0,01
400.000	EUR	Schneider Electric SE, 1.50%, 15/01/2028	379	0,05
100.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.25%, 12/06/2028	101	0,01
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 0.25%, 11/03/2029	176	0,03
100.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.13%, 13/10/2029	101	0,01
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.00%, 10/01/2031	200	0,03
300.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.50%, 09/11/2032	310	0,04
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.38%, 13/04/2034	203	0,03
300.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.25%, 10/10/2035	300	0,04
200.000	EUR	SCOR SE, FRN, 3.00%, 08/06/2046	195	0,03
400.000	EUR	SCOR SE, FRN, 3.63%, 27/05/2048	397	0,06
100.000	EUR	SCOR SE, FRN, 1.38%, 17/09/2051	80	0,01
200.000	EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, REIT, 1.50%, 05/06/2027	190	0,03
400.000	EUR	Societe Generale SA, 0.13%, 24/02/2026	376	0,05
400.000	EUR	Societe Generale SA, 0.88%, 01/07/2026	376	0,05
500.000	EUR	Societe Generale SA, 4.25%, 28/09/2026	509	0,07
300.000	EUR	Societe Generale SA, 0.75%, 25/01/2027	277	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
500.000	EUR	Societe Generale SA, 4.13%, 02/06/2027	510	0,07
300.000	EUR	Societe Generale SA, 0.25%, 08/07/2027	271	0,04
500.000	EUR	Societe Generale SA, 4.00%, 16/11/2027	509	0,07
300.000	EUR	Societe Generale SA, 1.38%, 13/01/2028	278	0,04
400.000	EUR	Societe Generale SA, 0.13%, 18/02/2028	353	0,05
200.000	EUR	Societe Generale SA, 2.13%, 27/09/2028	189	0,03
200.000	EUR	Societe Generale SA, 4.13%, 21/11/2028	206	0,03
200.000	EUR	Societe Generale SA, 1.75%, 22/03/2029	183	0,03
200.000	EUR	Societe Generale SA, 2.63%, 30/05/2029	193	0,03
100.000	EUR	Societe Generale SA, 0.88%, 24/09/2029	86	0,01
300.000	EUR	Societe Generale SA, 1.25%, 12/06/2030	260	0,04
500.000	EUR	Societe Generale SA, 4.25%, 16/11/2032	531	0,07
300.000	EUR	Societe Generale SA, 5.63%, 02/06/2033	321	0,05
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.13%, 21/04/2026	97	0,01
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.13%, 17/11/2026	189	0,03
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.63%, 02/12/2027	92	0,01
300.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.88%, 22/09/2028	272	0,04
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.50%, 12/06/2029	175	0,03
500.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 4.75%, 28/09/2029	520	0,07
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.00%, 24/11/2030	95	0,01
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 4.25%, 06/12/2030	204	0,03
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.13%, 30/06/2031	186	0,03
300.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 4.88%, 21/11/2031	315	0,04
100.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 5.25%, 06/09/2032	103	0,01
200.000	EUR	Sodexo SA, 0.75%, 27/04/2025	194	0,03
100.000	EUR	Sodexo SA, 2.50%, 24/06/2026	98	0,01
150.000	EUR	Sodexo SA, 0.75%, 14/04/2027	141	0,02
400.000	EUR	Sodexo SA, 1.00%, 17/07/2028	368	0,05
150.000	EUR	Sodexo SA, 1.00%, 27/04/2029	136	0,02
500.000	EUR	Sogecap SA, FRN, 4.13%, 18/02/2026 ¹	494	0,07
200.000	EUR	Sogecap SA, FRN, 6.50%, 16/05/2044	223	0,03
400.000	EUR	Suez SACA, 1.88%, 24/05/2027	380	0,05
500.000	EUR	Suez SACA, 4.63%, 03/11/2028	522	0,07
100.000	EUR	Suez SACA, 2.38%, 24/05/2030	93	0,01
200.000	EUR	Suez SACA, 5.00%, 03/11/2032	219	0,03
300.000	EUR	Suez SACA, 4.50%, 13/11/2033	317	0,04
200.000	EUR	Suez SACA, 2.88%, 24/05/2034	186	0,03
100.000	EUR	Teleperformance SE, 0.25%, 26/11/2027	87	0,01
200.000	EUR	Teleperformance SE, 5.25%, 22/11/2028	206	0,03
300.000	EUR	Teleperformance SE, 5.75%, 22/11/2031	315	0,04
100.000	EUR	Teleperformance SE, FRN, 1.88%, 02/07/2025	97	0,01
200.000	EUR	Teleperformance SE, FRN, 3.75%, 24/06/2029	195	0,03
100.000	EUR	Terega SA, 2.20%, 05/08/2025	98	0,01
100.000	EUR	Terega SA, 0.88%, 17/09/2030	84	0,01
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.38%, 19/03/2025	98	0,01
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 2.88%, 19/11/2025	99	0,01
400.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 2.50%, 25/03/2026	395	0,05
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.02%, 04/03/2027	94	0,01
500.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.49%, 08/04/2027	475	0,07
100.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.70%, 31/05/2028	90	0,01
300.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.75%, 12/07/2028	270	0,04
400.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.38%, 04/10/2029	362	0,05
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.49%, 04/09/2030	180	0,03
400.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.95%, 18/05/2031	342	0,05
400.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.99%, 08/04/2032	364	0,05
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.54%, 31/05/2039	156	0,02
200.000	EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.62%, 18/05/2040	154	0,02
300.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 3.37%, 10/06/2026 ¹	293	0,04
200.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.00%, 17/01/2027 ¹	186	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
300.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 1.63%, 25/10/2027 ¹	271	0,04
200.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.00%, 06/04/2030 ¹	173	0,02
550.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 2.13%, 25/07/2032 ¹	451	0,07
150.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 3.25%, 17/07/2036 ¹	128	0,02
300.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.88%, 21/02/2025	292	0,04
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.13%, 09/04/2025	196	0,03
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 09/03/2026	192	0,03
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.50%, 04/06/2026	98	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.00%, 27/02/2027	93	0,01
150.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.13%, 28/04/2027	140	0,02
400.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.63%, 04/05/2027	367	0,05
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.50%, 22/02/2028	93	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.75%, 25/10/2028	89	0,01
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.50%, 29/05/2029	180	0,03
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.63%, 09/04/2030	194	0,03
150.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 15/04/2030	131	0,02
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 4.13%, 11/12/2030	203	0,03
500.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.88%, 15/01/2031	440	0,06
500.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 04/12/2031	420	0,06
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.88%, 29/03/2032	161	0,02
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 29/06/2032	175	0,03
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.38%, 25/05/2033	81	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.75%, 27/02/2034	85	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 28/04/2036	84	0,01
300.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.00%, 29/05/2037	247	0,04
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.25%, 14/05/2038	167	0,02
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.75%, 01/07/2049	64	0,01
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 2.88%, 25/01/2026 ¹	95	0,01
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 7.25%, 07/03/2028 ¹	212	0,03
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.00%, 03/04/2025	195	0,03
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.75%, 10/09/2025	97	0,01
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.00%, 09/06/2026	279	0,04
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.50%, 30/11/2026	287	0,04
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.00%, 14/01/2027	182	0,03
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 4.63%, 30/03/2027	104	0,02
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.59%, 10/01/2028	94	0,01
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.25%, 15/04/2028	278	0,04
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.25%, 19/05/2028	276	0,04
400.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.93%, 04/01/2029	358	0,05
300.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.50%, 03/04/2029	275	0,04
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.94%, 07/01/2030	185	0,03
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.63%, 17/09/2030	90	0,01
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.66%, 15/01/2031	84	0,01
400.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.50%, 14/10/2031	325	0,05
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 0.80%, 15/01/2032	82	0,01
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.63%, 21/09/2032	173	0,02
150.000	EUR	Veolia Environnement SA, 6.13%, 25/11/2033	183	0,03
100.000	EUR	Veolia Environnement SA, 1.25%, 14/05/2035	81	0,01
100.000	EUR	Verallia SA, FRN, 1.63%, 14/05/2028	92	0,01
100.000	EUR	Verallia SA, FRN, 1.88%, 10/11/2031	87	0,01
200.000	EUR	Vinci SA, 1.00%, 26/09/2025	193	0,03
300.000	EUR	Vinci SA, 0.00%, 27/11/2028	262	0,04
200.000	EUR	Vinci SA, 1.63%, 18/01/2029	187	0,03
300.000	EUR	Vinci SA, 1.75%, 26/09/2030	274	0,04
300.000	EUR	Vinci SA, 0.50%, 09/01/2032	243	0,03
100.000	EUR	Vinci SA, 3.38%, 17/10/2032	100	0,01
100.000	EUR	Vivendi SE, 0.63%, 11/06/2025	97	0,01
200.000	EUR	Vivendi SE, 1.13%, 11/12/2028	191	0,03
100.000	EUR	Wendel SE, 2.50%, 09/02/2027	98	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Wendel SE, 1.00%, 01/06/2031	84	0,01
100.000	EUR	Wendel SE, 1.38%, 18/01/2034	81	0,01
100.000	EUR	Worldline SA, 0.88%, 30/06/2027	90	0,01
200.000	EUR	Worldline SA, 4.13%, 12/09/2028	197	0,03
350.000	EUR	WPP Finance SA, 2.25%, 22/09/2026	341	0,05
200.000	EUR	WPP Finance SA, 2.38%, 19/05/2027	194	0,03
300.000	EUR	WPP Finance SA, 4.13%, 30/05/2028	306	0,04
Frankreich - Gesamt			148.215	20,69
Deutschland (31. März 2023: 8,94 %)				
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.05%, 02/09/2026	88	0,01
300.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.50%, 07/04/2027	258	0,04
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.25%, 23/11/2027	83	0,01
100.000	EUR	Aareal Bank AG, 0.75%, 18/04/2028	84	0,01
100.000	EUR	adidas AG, 3.00%, 21/11/2025	99	0,01
100.000	EUR	adidas AG, 3.13%, 21/11/2029	100	0,01
300.000	EUR	adidas AG, 0.63%, 10/09/2035	227	0,03
100.000	EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.13%, 25/11/2025	96	0,01
300.000	EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.63%, 25/11/2028	273	0,04
500.000	EUR	Allianz SE, FRN, 4.60%, 07/09/2038	510	0,07
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 2.24%, 07/07/2045	293	0,04
400.000	EUR	Allianz SE, FRN, 3.10%, 06/07/2047	390	0,05
200.000	EUR	Allianz SE, FRN, 1.30%, 25/09/2049	174	0,02
200.000	EUR	Allianz SE, FRN, 2.12%, 08/07/2050	178	0,03
400.000	EUR	Allianz SE, FRN, 4.25%, 05/07/2052	401	0,06
300.000	EUR	Allianz SE, FRN, 5.82%, 25/07/2053	334	0,05
400.000	EUR	Allianz SE, FRN, 4.85%, 26/07/2054	418	0,06
100.000	EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 0.75%, 04/05/2026	94	0,01
100.000	EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 2.00%, 08/10/2028	96	0,01
300.000	EUR	Amprion GmbH, 3.45%, 22/09/2027	300	0,04
300.000	EUR	Amprion GmbH, 3.88%, 07/09/2028	306	0,04
400.000	EUR	Amprion GmbH, 3.97%, 22/09/2032	412	0,06
200.000	EUR	Amprion GmbH, 0.63%, 23/09/2033	154	0,02
100.000	EUR	Amprion GmbH, 4.13%, 07/09/2034	104	0,02
150.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 22/05/2025	146	0,02
400.000	EUR	BASF SE, 0.75%, 17/03/2026	380	0,05
400.000	EUR	BASF SE, 0.25%, 05/06/2027	365	0,05
250.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 15/11/2027	232	0,03
200.000	EUR	BASF SE, 3.13%, 29/06/2028	200	0,03
200.000	EUR	BASF SE, 4.00%, 08/03/2029	206	0,03
300.000	EUR	BASF SE, 1.50%, 17/03/2031	267	0,04
100.000	EUR	BASF SE, 0.88%, 06/10/2031	85	0,01
200.000	EUR	BASF SE, 4.25%, 08/03/2032	211	0,03
100.000	EUR	BASF SE, 3.75%, 29/06/2032	102	0,02
200.000	EUR	BASF SE, 4.50%, 08/03/2035	214	0,03
350.000	EUR	BASF SE, 1.63%, 15/11/2037	280	0,04
150.000	EUR	Bayer AG, 4.00%, 26/08/2026	151	0,02
300.000	EUR	Bayer AG, 0.75%, 06/01/2027	276	0,04
300.000	EUR	Bayer AG, 0.38%, 12/01/2029	255	0,04
450.000	EUR	Bayer AG, 4.25%, 26/08/2029	459	0,06
300.000	EUR	Bayer AG, 1.13%, 06/01/2030	255	0,04
200.000	EUR	Bayer AG, 0.63%, 12/07/2031	156	0,02
500.000	EUR	Bayer AG, 1.38%, 06/07/2032	403	0,06
575.000	EUR	Bayer AG, 4.63%, 26/05/2033	594	0,08
200.000	EUR	Bayer AG, 1.00%, 12/01/2036	141	0,02
100.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.25%, 22/01/2025	98	0,01
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.38%, 25/01/2027	181	0,03
100.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.13%, 25/10/2027	90	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Deutschland (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.50%, 18/04/2028	184	0,03
200.000	EUR	Berlin Hyp AG, FRN, 0.38%, 21/04/2031	158	0,02
100.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.25%, 29/09/2025	97	0,01
200.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.13%, 27/04/2026	191	0,03
200.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 2.00%, 01/04/2028	191	0,03
200.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 3.50%, 29/05/2029	200	0,03
100.000	EUR	Bertelsmann SE & Co. KGaA, 1.50%, 15/05/2030	90	0,01
100.000	EUR	Clearstream Banking AG, 0.00%, 01/12/2025	94	0,01
200.000	EUR	Commerzbank AG, 0.10%, 11/09/2025	190	0,03
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.13%, 19/09/2025	97	0,01
500.000	EUR	Commerzbank AG, 1.00%, 04/03/2026	477	0,07
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.13%, 22/06/2026	94	0,01
100.000	EUR	Commerzbank AG, 0.50%, 04/12/2026	93	0,01
100.000	EUR	Commerzbank AG, 0.88%, 22/01/2027	93	0,01
175.000	EUR	Commerzbank AG, 0.38%, 01/09/2027	160	0,02
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.88%, 28/02/2028	95	0,01
100.000	EUR	Commerzbank AG, 1.50%, 28/08/2028	94	0,01
200.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 3.00%, 14/09/2027	196	0,03
200.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 4.63%, 21/03/2028	204	0,03
400.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 5.13%, 18/01/2030	418	0,06
300.000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 4.63%, 17/01/2031	308	0,04
210.000	EUR	Continental AG, 0.38%, 27/06/2025	202	0,03
400.000	EUR	Continental AG, 2.50%, 27/08/2026	393	0,06
100.000	EUR	Continental AG, 3.63%, 30/11/2027	101	0,01
375.000	EUR	Continental AG, 4.00%, 01/06/2028	384	0,05
100.000	EUR	Covestro AG, 0.88%, 03/02/2026	95	0,01
200.000	EUR	Covestro AG, 4.75%, 15/11/2028	210	0,03
100.000	EUR	Covestro AG, 1.38%, 12/06/2030	89	0,01
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, 2.63%, 12/02/2026	98	0,01
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 4.50%, 19/05/2026	201	0,03
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.63%, 20/01/2027	377	0,05
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, 4.00%, 29/11/2027	305	0,04
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 1.75%, 17/01/2028	186	0,03
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.38%, 10/06/2026	97	0,01
200.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.38%, 03/09/2026	193	0,03
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 0.75%, 17/02/2027	283	0,04
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.88%, 23/02/2028	376	0,05
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 3.25%, 24/05/2028	98	0,01
100.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 5.38%, 11/01/2029	105	0,02
500.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 3.75%, 15/01/2030	501	0,07
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 4.13%, 04/04/2030	300	0,04
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 5.00%, 05/09/2030	415	0,06
600.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.75%, 19/11/2030	528	0,07
300.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 5.63%, 19/05/2031	303	0,04
400.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.38%, 17/02/2032	336	0,05
500.000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 4.00%, 24/06/2032	484	0,07
300.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 1.63%, 08/10/2025	292	0,04
300.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 3.88%, 28/09/2026	304	0,04
300.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 1.13%, 26/03/2028	279	0,04
500.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 3.75%, 28/09/2029	515	0,07
100.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 0.13%, 22/02/2031	82	0,01
100.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 1.50%, 04/04/2032	89	0,01
300.000	EUR	Deutsche Boerse AG, 3.88%, 28/09/2033	315	0,04
200.000	EUR	Deutsche Boerse AG, FRN, 1.25%, 16/06/2047	183	0,03
200.000	EUR	Deutsche Boerse AG, FRN, 2.00%, 23/06/2048	184	0,03
200.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 3.00%, 29/05/2026	196	0,03
500.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.88%, 16/05/2027	484	0,07
200.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 3.75%, 11/02/2028	199	0,03
100.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 3.50%, 14/07/2029	98	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Deutschland (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 17/01/2025	93	0,01
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 27/10/2025	88	0,01
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.10%, 02/02/2026	86	0,01
100.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 4.38%, 28/08/2026	93	0,01
200.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 5.00%, 05/02/2027	190	0,03
200.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.25%, 01/04/2026	193	0,03
250.000	EUR	Deutsche Post AG, 0.38%, 20/05/2026	236	0,03
75.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.00%, 13/12/2027	70	0,01
125.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.63%, 05/12/2028	118	0,02
200.000	EUR	Deutsche Post AG, 0.75%, 20/05/2029	181	0,03
150.000	EUR	Deutsche Post AG, 1.00%, 20/05/2032	130	0,02
125.000	EUR	Deutsche Post AG, 3.50%, 25/03/2036	126	0,02
225.000	EUR	Deutsche Post AG, FRN, 3.38%, 03/07/2033	230	0,03
100.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 0.88%, 25/03/2026	95	0,01
200.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 0.50%, 05/07/2027	185	0,03
300.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 1.75%, 25/03/2031	276	0,04
200.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 1.38%, 05/07/2034	171	0,02
275.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 3.25%, 20/03/2036	275	0,04
100.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 2.25%, 29/03/2039	90	0,01
400.000	EUR	Deutsche Telekom AG, 1.75%, 09/12/2049	301	0,04
100.000	EUR	Deutsche Wohnen SE, REIT, 1.00%, 30/04/2025	97	0,01
300.000	EUR	Deutsche Wohnen SE, REIT, 1.50%, 30/04/2030	262	0,04
100.000	EUR	Deutsche Wohnen SE, REIT, 1.30%, 07/04/2041	65	0,01
100.000	EUR	E.ON SE, 1.00%, 07/10/2025	97	0,01
200.000	EUR	E.ON SE, 0.13%, 18/01/2026	189	0,03
200.000	EUR	E.ON SE, 0.25%, 24/10/2026	186	0,03
465.000	EUR	E.ON SE, 0.38%, 29/09/2027	423	0,06
200.000	EUR	E.ON SE, 3.50%, 12/01/2028	202	0,03
100.000	EUR	E.ON SE, 0.75%, 20/02/2028	92	0,01
100.000	EUR	E.ON SE, 2.88%, 26/08/2028	99	0,01
125.000	EUR	E.ON SE, 0.10%, 19/12/2028	111	0,02
375.000	EUR	E.ON SE, 3.75%, 01/03/2029	383	0,05
150.000	EUR	E.ON SE, 1.63%, 22/05/2029	139	0,02
150.000	EUR	E.ON SE, 0.35%, 28/02/2030	127	0,02
100.000	EUR	E.ON SE, 0.75%, 18/12/2030	86	0,01
325.000	EUR	E.ON SE, 3.38%, 15/01/2031	325	0,05
250.000	EUR	E.ON SE, 1.63%, 29/03/2031	224	0,03
70.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 20/08/2031	59	0,01
250.000	EUR	E.ON SE, 0.63%, 07/11/2031	205	0,03
150.000	EUR	E.ON SE, 3.50%, 25/03/2032	151	0,02
175.000	EUR	E.ON SE, 0.60%, 01/10/2032	141	0,02
100.000	EUR	E.ON SE, 4.00%, 29/08/2033	104	0,02
125.000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 18/10/2034	98	0,01
375.000	EUR	E.ON SE, 3.88%, 12/01/2035	384	0,05
300.000	EUR	E.ON SE, 3.75%, 15/01/2036	303	0,04
200.000	EUR	E.ON SE, 3.50%, 26/10/2037	194	0,03
300.000	EUR	E.ON SE, 4.13%, 25/03/2044	308	0,04
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.88%, 10/06/2025	196	0,03
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.50%, 18/04/2028	185	0,03
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 3.60%, 01/02/2029	201	0,03
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 3.72%, 27/04/2030	203	0,03
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 3.28%, 05/09/2031	198	0,03
200.000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.11%, 15/05/2032	167	0,02
100.000	EUR	Eurogrid GmbH, 0.74%, 21/04/2033	79	0,01
400.000	EUR	Eurogrid GmbH, 3.92%, 01/02/2034	408	0,06
100.000	EUR	Evonik Industries AG, 0.63%, 18/09/2025	96	0,01
400.000	EUR	Evonik Industries AG, 2.25%, 25/09/2027	385	0,05
75.000	EUR	Evonik Industries AG, 0.75%, 07/09/2028	68	0,01
150.000	EUR	Fresenius Medical Care AG, 1.50%, 11/07/2025	146	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Deutschland (Fortsetzung)				
300.000	EUR	Fresenius Medical Care AG, 1.00%, 29/05/2026	284	0,04
300.000	EUR	Fresenius Medical Care AG, 3.88%, 20/09/2027	303	0,04
50.000	EUR	Fresenius Medical Care AG, 1.25%, 29/11/2029	43	0,01
200.000	EUR	Fresenius Medical Care AG, 1.50%, 29/05/2030	175	0,03
150.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 1.88%, 24/05/2025	147	0,02
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 4.25%, 28/05/2026	101	0,02
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 0.38%, 28/09/2026	93	0,01
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 1.63%, 08/10/2027	94	0,01
400.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 0.75%, 15/01/2028	361	0,05
175.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 2.88%, 15/02/2029	172	0,02
100.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 5.00%, 28/11/2029	105	0,02
150.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 2.88%, 24/05/2030	144	0,02
250.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 5.13%, 05/10/2030	269	0,04
150.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 1.13%, 28/01/2033	121	0,02
300.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 4.88%, 17/03/2025	299	0,04
200.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.38%, 09/03/2026	182	0,03
150.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 4.88%, 30/03/2027	151	0,02
100.000	EUR	Hamburg Commercial Bank AG, FRN, 0.50%, 22/09/2026	91	0,01
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, 1.13%, 18/04/2028	95	0,01
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 3.38%, 26/06/2025 ¹	99	0,01
200.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.13%, 09/10/2039	172	0,02
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.75%, 08/10/2040	87	0,01
100.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 1.38%, 30/06/2042	82	0,01
400.000	EUR	Hannover Rueck SE, FRN, 5.88%, 26/08/2043	451	0,06
175.000	EUR	Heidelberg Materials AG, 1.50%, 07/02/2025	172	0,02
150.000	EUR	Heidelberg Materials AG, FRN, 3.75%, 31/05/2032	151	0,02
100.000	EUR	Hella GmbH & Co. KGaA, 0.50%, 26/01/2027	91	0,01
400.000	EUR	Henkel AG & Co. KGaA, FRN, 2.63%, 13/09/2027	394	0,06
100.000	EUR	Henkel AG & Co. KGaA, FRN, 0.50%, 17/11/2032	82	0,01
250.000	EUR	Hochtief AG, 1.75%, 03/07/2025	244	0,03
50.000	EUR	Hochtief AG, 0.50%, 03/09/2027	45	0,01
175.000	EUR	Hochtief AG, 0.63%, 26/04/2029	151	0,02
200.000	EUR	Infineon Technologies AG, 0.63%, 17/02/2025	195	0,03
400.000	EUR	Infineon Technologies AG, 1.13%, 24/06/2026	381	0,05
200.000	EUR	Infineon Technologies AG, 1.63%, 24/06/2029	184	0,03
100.000	EUR	Infineon Technologies AG, 2.00%, 24/06/2032	90	0,01
200.000	EUR	Infineon Technologies AG, FRN, 3.63%, 01/01/2028 ¹	194	0,03
200.000	EUR	KION Group AG, 1.63%, 24/09/2025	193	0,03
275.000	EUR	Knorr-Bremse AG, 1.13%, 13/06/2025	267	0,04
200.000	EUR	Knorr-Bremse AG, FRN, 3.25%, 21/09/2027	199	0,03
300.000	EUR	Lanxess AG, 1.13%, 16/05/2025	291	0,04
300.000	EUR	Lanxess AG, 1.00%, 07/10/2026	282	0,04
75.000	EUR	Lanxess AG, 0.00%, 08/09/2027	66	0,01
100.000	EUR	Lanxess AG, FRN, 1.75%, 22/03/2028	92	0,01
200.000	EUR	Lanxess AG, FRN, 0.63%, 01/12/2029	163	0,02
200.000	EUR	LANXESS AG, 0.00%, 08/09/2027	176	0,02
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.38%, 17/01/2026	188	0,03
500.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.88%, 28/11/2027	455	0,06
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.75%, 30/06/2031	160	0,02
100.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 1.00%, 19/11/2032	78	0,01
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 0.88%, 30/03/2033	153	0,02
200.000	EUR	LEG Immobilien SE, REIT, 1.50%, 17/01/2034	158	0,02
175.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.00%, 15/11/2027	163	0,02
350.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.38%, 11/05/2028	327	0,05
550.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.50%, 03/07/2029	507	0,07
150.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 08/02/2030	131	0,02
175.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.38%, 22/05/2030	168	0,02
200.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 10/09/2030	174	0,03
150.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.00%, 27/02/2031	140	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Deutschland (Fortsetzung)				
300.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.13%, 06/11/2031	259	0,04
200.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 11/03/2033	163	0,02
100.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.13%, 08/08/2034	83	0,01
425.000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.13%, 03/07/2037	377	0,05
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.13%, 16/07/2025	192	0,03
400.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 1.88%, 15/06/2026	389	0,06
100.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.38%, 05/07/2027	92	0,01
100.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.50%, 16/07/2028	90	0,01
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 2.38%, 15/06/2030	192	0,03
200.000	EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.88%, 05/07/2031	171	0,02
100.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 2.88%, 25/06/2079	93	0,01
200.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.63%, 09/09/2080	188	0,03
100.000	EUR	Metro AG, 1.50%, 19/03/2025	98	0,01
200.000	EUR	METRO AG, 4.63%, 07/03/2029	204	0,03
100.000	EUR	MTU Aero Engines AG, 3.00%, 01/07/2025	99	0,01
100.000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.88%, 12/09/2025	95	0,01
100.000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.50%, 08/06/2026	92	0,01
100.000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.38%, 09/03/2029	84	0,01
300.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 1.25%, 26/05/2041	251	0,04
300.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 1.00%, 26/05/2042	239	0,03
200.000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 3.25%, 26/05/2049	193	0,03
200.000	EUR	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH, FRN, 1.75%, 05/07/2025	195	0,03
100.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 3.63%, 02/06/2027	101	0,02
200.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 3.63%, 02/06/2030	204	0,03
200.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 4.00%, 02/06/2035	208	0,03
500.000	EUR	Robert Bosch GmbH, 4.38%, 02/06/2043	532	0,08
300.000	EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.50%, 30/06/2026	303	0,04
100.000	EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.38%, 13/09/2027	102	0,02
100.000	EUR	SAP SE, 1.00%, 01/04/2025	98	0,01
100.000	EUR	SAP SE, 1.00%, 13/03/2026	96	0,01
200.000	EUR	SAP SE, 0.13%, 18/05/2026	188	0,03
100.000	EUR	SAP SE, 1.75%, 22/02/2027	97	0,01
300.000	EUR	SAP SE, 1.25%, 10/03/2028	281	0,04
200.000	EUR	SAP SE, 0.38%, 18/05/2029	176	0,03
200.000	EUR	SAP SE, 1.38%, 13/03/2030	183	0,03
200.000	EUR	SAP SE, 1.63%, 10/03/2031	184	0,03
100.000	EUR	Talanx AG, 2.50%, 23/07/2026	98	0,01
100.000	EUR	Talanx AG, 4.00%, 25/10/2029	103	0,02
100.000	EUR	Talanx AG, FRN, 1.75%, 01/12/2042	84	0,01
300.000	EUR	Talanx AG, FRN, 2.25%, 05/12/2047	280	0,04
200.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 2.88%, 12/06/2025	198	0,03
300.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.00%, 26/09/2027	305	0,04
200.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 1.50%, 25/09/2028	185	0,03
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 0.13%, 10/09/2029	85	0,01
100.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.63%, 26/09/2032	107	0,02
200.000	EUR	Vier Gas Transport GmbH, 0.50%, 10/09/2034	147	0,02
500.000	EUR	Volkswagen Bank GmbH, 1.25%, 15/12/2025	481	0,07
300.000	EUR	Volkswagen Bank GmbH, 2.50%, 31/07/2026	292	0,04
300.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.13%, 12/02/2027	273	0,04
1.000.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 2.25%, 01/10/2027	964	0,14
500.000	EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.88%, 31/01/2028	451	0,06
500.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.25%, 12/01/2026	470	0,07
300.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 4.50%, 25/03/2026	304	0,04
500.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.38%, 20/07/2026	464	0,07
150.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 3.63%, 11/10/2026	150	0,02
225.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 3.88%, 11/10/2028	227	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Deutschland (Fortsetzung)				
500.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.50%, 12/01/2029	433	0,06
175.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 4.00%, 11/04/2031	177	0,03
200.000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 4.75%, 25/09/2031	212	0,03
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.80%, 29/06/2025	195	0,03
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.13%, 08/09/2025	96	0,01
400.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.00%, 01/12/2025	375	0,05
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.38%, 28/01/2026	96	0,01
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.50%, 22/03/2026	96	0,01
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.50%, 10/06/2026	191	0,03
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 09/07/2026	187	0,03
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 4.75%, 23/05/2027	308	0,04
500.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.38%, 16/06/2027	450	0,06
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 07/10/2027	90	0,01
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.50%, 14/01/2028	92	0,01
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.88%, 28/06/2028	92	0,01
500.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.25%, 01/09/2028	427	0,06
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.50%, 14/09/2029	83	0,01
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 14/12/2029	166	0,02
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 2.13%, 22/03/2030	269	0,04
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 2.25%, 07/04/2030	91	0,01
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.00%, 09/07/2030	84	0,01
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 5.00%, 23/11/2030	316	0,04
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 24/03/2031	159	0,02
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 2.38%, 25/03/2032	177	0,03
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.75%, 01/09/2032	228	0,03
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.00%, 16/06/2033	151	0,02
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.13%, 14/09/2034	222	0,03
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.63%, 07/10/2039	69	0,01
100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.00%, 28/01/2041	60	0,01
300.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.50%, 14/06/2041	193	0,03
200.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.63%, 01/09/2051	115	0,02
200.000	EUR	WPP Finance Deutschland GmbH, 1.63%, 23/03/2030	178	0,03
100.000	EUR	Wuestenrot & Wuerttembergische AG, FRN, 2.13%, 10/09/2041	76	0,01
Deutschland - Gesamt			64.876	9,06
Guernsey (31. März 2023: 0,05 %)				
200.000	EUR	Sirius Real Estate Ltd., REIT, 1.13%, 22/06/2026	185	0,03
100.000	EUR	Sirius Real Estate Ltd., REIT, 1.75%, 24/11/2028	86	0,01
Guernsey - Gesamt			271	0,04
Hongkong (31. März 2023: 0,03 %)				
200.000	EUR	AIA Group Ltd., FRN, 0.88%, 09/09/2033	173	0,02
Hongkong - Gesamt			173	0,02
Ungarn (31. März 2023: 0,08 %)				
100.000	EUR	MOL Hungarian Oil & Gas plc, 1.50%, 08/10/2027	92	0,01
100.000	EUR	OTP Bank Nyrt., FRN, 6.13%, 05/10/2027	103	0,02
300.000	EUR	OTP Bank Nyrt., FRN, 5.00%, 31/01/2029	300	0,04
Ungarn - Gesamt			495	0,07
Island (31. März 2023: 0,02 %)				
250.000	EUR	Arion Banki HF, 7.25%, 25/05/2026	263	0,04
Island - Gesamt			263	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Irland (31. März 2023: 1,86 %)				
230.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 1.50%, 27/09/2026	221	0,03
150.000	EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 0.38%, 19/11/2027	137	0,02
100.000	EUR	AIB Group plc, 2.25%, 03/07/2025	98	0,01
300.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 3.63%, 04/07/2026	299	0,04
100.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 0.50%, 17/11/2027	92	0,01
425.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 2.25%, 04/04/2028	407	0,06
400.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 5.75%, 16/02/2029	429	0,06
200.000	EUR	AIB Group plc, FRN, 5.25%, 23/10/2031	216	0,03
300.000	EUR	Atlas Copco Finance DAC, 0.75%, 08/02/2032	251	0,04
325.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.88%, 05/06/2026	317	0,04
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 0.38%, 10/05/2027	187	0,03
300.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 4.88%, 16/07/2028	311	0,04
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 4.63%, 13/11/2029	206	0,03
100.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 5.00%, 04/07/2031	107	0,02
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.38%, 11/08/2031	187	0,03
100.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 6.75%, 01/03/2033	107	0,02
500.000	EUR	CA Auto Bank SpA, 4.38%, 08/06/2026	505	0,07
150.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.50%, 06/09/2029	130	0,02
325.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.88%, 06/05/2033	262	0,04
200.000	EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 1.50%, 06/05/2041	148	0,02
150.000	EUR	CRH Finance DAC, 1.38%, 18/10/2028	138	0,02
400.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 1.25%, 05/11/2026	379	0,05
200.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.00%, 11/07/2027	204	0,03
300.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.00%, 11/07/2031	309	0,04
100.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.25%, 11/07/2035	105	0,01
100.000	EUR	Dell Bank International DAC, 0.50%, 27/10/2026	93	0,01
400.000	EUR	Dell Bank International DAC, 4.50%, 18/10/2027	412	0,06
150.000	EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.45%, 15/09/2027	134	0,02
200.000	EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.95%, 15/09/2031	157	0,02
100.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.70%, 14/05/2025	97	0,01
200.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.13%, 08/03/2026	188	0,03
300.000	EUR	Eaton Capital Unlimited Co., 0.58%, 08/03/2030	257	0,04
200.000	EUR	Experian Europe DAC, 1.56%, 16/05/2031	178	0,02
300.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 0.00%, 01/10/2025	285	0,04
150.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 2.13%, 01/02/2027	144	0,02
100.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 0.50%, 01/10/2028	88	0,01
100.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 0.88%, 01/10/2031	81	0,01
250.000	EUR	Fresenius Finance Ireland plc, 3.00%, 30/01/2032	236	0,03
150.000	EUR	GE Capital European Funding Unlimited Co., 6.03%, 01/03/2038	189	0,03
200.000	EUR	Grenke Finance plc, 7.88%, 06/04/2027	216	0,03
250.000	EUR	Hammerson Ireland Finance DAC, REIT, FRN, 1.75%, 03/06/2027	231	0,03
100.000	EUR	Johnson Controls International plc, 1.38%, 25/02/2025	98	0,01
150.000	EUR	Johnson Controls International plc, 0.38%, 15/09/2027	135	0,02
100.000	EUR	Johnson Controls International plc, 3.00%, 15/09/2028	99	0,01
125.000	EUR	Johnson Controls International plc, 1.00%, 15/09/2032	103	0,01
250.000	EUR	Johnson Controls International plc, 4.25%, 23/05/2035	262	0,04
200.000	EUR	Kerry Group Financial Services Unlimited Co., 2.38%, 10/09/2025	196	0,03
250.000	EUR	Kerry Group Financial Services Unlimited Co., 0.63%, 20/09/2029	217	0,03
200.000	EUR	Kerry Group Financial Services Unlimited Co., FRN, 0.88%, 01/12/2031	168	0,02
200.000	EUR	Linde plc, 0.00%, 30/09/2026	185	0,03
300.000	EUR	Linde plc, 1.00%, 31/03/2027	282	0,04
300.000	EUR	Linde plc, 3.00%, 14/02/2028	299	0,04
300.000	EUR	Linde plc, 3.38%, 12/06/2029	304	0,04
100.000	EUR	Linde plc, 3.20%, 14/02/2031	100	0,01
100.000	EUR	Linde plc, 1.38%, 31/03/2031	89	0,01
300.000	EUR	Linde plc, 0.38%, 30/09/2033	231	0,03
200.000	EUR	Linde plc, 3.63%, 12/06/2034	206	0,03
400.000	EUR	Linde plc, 1.63%, 31/03/2035	338	0,05
200.000	EUR	Linde plc, 3.40%, 14/02/2036	201	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Irland (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Linde plc, 1.00%, 30/09/2051	61	0,01
200.000	EUR	Ryanair DAC, 2.88%, 15/09/2025	198	0,03
300.000	EUR	Ryanair DAC, 0.88%, 25/05/2026	283	0,04
250.000	EUR	Securitas Treasury Ireland DAC, 4.25%, 04/04/2027	254	0,04
125.000	EUR	Securitas Treasury Ireland DAC, 4.38%, 06/03/2029	129	0,02
100.000	EUR	Securitas Treasury Ireland DAC, 3.88%, 23/02/2030	101	0,01
350.000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.88%, 15/01/2026	344	0,05
400.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.50%, 15/09/2027	374	0,05
100.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 0.50%, 22/09/2029	86	0,01
100.000	EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.00%, 22/09/2033	80	0,01
350.000	EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.25%, 02/03/2029	350	0,05
250.000	EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.75%, 02/12/2034	255	0,04
125.000	EUR	Vodafone International Financing DAC, 4.00%, 10/02/2043	127	0,02
100.000	EUR	Zurich Finance (Ireland) Designated Activity Co., 1.63%, 17/06/2039	80	0,01
200.000	EUR	Zurich Finance (Ireland) Designated Activity Co., FRN, 1.88%, 17/09/2050	176	0,02
Irland - Gesamt			15.149	2,11
Italien (31. März 2023: 4,36 %)				
100.000	EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.63%, 02/02/2029	91	0,01
100.000	EUR	Aeroporti di Roma SpA, FRN, 1.75%, 30/07/2031	87	0,01
100.000	EUR	Aeroporti di Roma SpA, FRN, 4.88%, 10/07/2033	107	0,02
150.000	EUR	Anima Holding SpA, 1.50%, 22/04/2028	137	0,02
400.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 4.13%, 04/05/2026	403	0,06
150.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 3.21%, 15/01/2029	149	0,02
100.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 3.88%, 29/01/2029	101	0,01
150.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.12%, 01/10/2030	134	0,02
100.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.43%, 14/07/2031	89	0,01
150.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 1.71%, 30/06/2032	125	0,02
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.80%, 06/07/2032	219	0,03
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.40%, 20/04/2033	214	0,03
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.27%, 12/09/2033	213	0,03
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 3.55%, 15/01/2034	198	0,03
200.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 4.60%, 21/11/2025 ¹	200	0,03
300.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 5.50%, 27/10/2047	312	0,04
350.000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, FRN, 5.00%, 08/06/2048	361	0,05
100.000	EUR	ASTM SpA, 1.63%, 08/02/2028	93	0,01
250.000	EUR	ASTM SpA, FRN, 1.00%, 25/11/2026	234	0,03
450.000	EUR	ASTM SpA, FRN, 1.50%, 25/01/2030	392	0,06
200.000	EUR	ASTM SpA, FRN, 2.38%, 25/11/2033	170	0,02
300.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.75%, 01/02/2027	285	0,04
600.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 2.00%, 04/12/2028	556	0,08
400.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 2.00%, 15/01/2030	363	0,05
300.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, FRN, 4.25%, 28/06/2032	301	0,04
300.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, FRN, 4.63%, 28/02/2036	303	0,04
100.000	EUR	Banco BPM SpA, 1.75%, 28/01/2025	98	0,01
350.000	EUR	Banco BPM SpA, 0.88%, 15/07/2026	329	0,05
150.000	EUR	Banco BPM SpA, 6.00%, 13/09/2026	157	0,02
200.000	EUR	Banco BPM SpA, 4.88%, 18/01/2027	206	0,03
100.000	EUR	Banco BPM SpA, 4.63%, 29/11/2027	103	0,02
150.000	EUR	Banco BPM SpA, FRN, 6.00%, 21/01/2028	157	0,02
200.000	EUR	Banco BPM SpA, FRN, 6.00%, 14/06/2028	211	0,03
200.000	EUR	Banco BPM SpA, FRN, 4.88%, 17/01/2030	206	0,03
200.000	EUR	Credito Emiliano SpA, FRN, 1.13%, 19/01/2028	187	0,03
150.000	EUR	Credito Emiliano SpA, FRN, 4.88%, 26/03/2030	158	0,02
100.000	EUR	Enel SpA, 5.63%, 21/06/2027	107	0,02
230.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.50%, 24/02/2025 ¹	227	0,03
150.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.38%, 24/08/2026 ¹	145	0,02
300.000	EUR	Enel SpA, FRN, 2.25%, 12/10/2026 ¹	280	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Italien (Fortsetzung)				
400.000	EUR	Enel SpA, FRN, 1.38%, 06/08/2027 ¹	356	0,05
200.000	EUR	Enel SpA, FRN, 6.38%, 16/04/2028 ¹	211	0,03
200.000	EUR	Enel SpA, FRN, 4.75%, 28/02/2029 ¹	199	0,03
350.000	EUR	Enel SpA, FRN, 1.88%, 06/08/2030 ¹	289	0,04
200.000	EUR	Enel SpA, FRN, 6.63%, 16/04/2031 ¹	218	0,03
250.000	EUR	Eni SpA, 3.75%, 12/09/2025	251	0,04
200.000	EUR	Eni SpA, 1.50%, 02/02/2026	193	0,03
350.000	EUR	Eni SpA, 1.25%, 18/05/2026	334	0,05
150.000	EUR	Eni SpA, 1.50%, 17/01/2027	143	0,02
400.000	EUR	Eni SpA, 1.63%, 17/05/2028	373	0,05
100.000	EUR	Eni SpA, 1.13%, 19/09/2028	91	0,01
350.000	EUR	Eni SpA, 3.63%, 29/01/2029	355	0,05
200.000	EUR	Eni SpA, 0.63%, 23/01/2030	171	0,02
300.000	EUR	Eni SpA, 2.00%, 18/05/2031	272	0,04
350.000	EUR	Eni SpA, 4.25%, 19/05/2033	365	0,05
250.000	EUR	Eni SpA, 3.88%, 15/01/2034	253	0,04
140.000	EUR	Eni SpA, 1.00%, 11/10/2034	108	0,02
575.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.63%, 13/10/2025 ¹	557	0,08
200.000	EUR	Eni SpA, FRN, 3.63%, 19/05/2027	201	0,03
300.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.00%, 02/11/2027 ¹	277	0,04
300.000	EUR	Eni SpA, FRN, 0.38%, 14/06/2028	265	0,04
475.000	EUR	Eni SpA, FRN, 3.38%, 13/07/2029 ¹	441	0,06
250.000	EUR	Eni SpA, FRN, 2.75%, 02/11/2030 ¹	220	0,03
200.000	EUR	ERG SpA, 1.88%, 11/04/2025	196	0,03
300.000	EUR	ERG SpA, 0.50%, 11/09/2027	270	0,04
100.000	EUR	ERG SpA, 0.88%, 15/09/2031	80	0,01
100.000	EUR	FinecoBank Banca Fineco SpA, FRN, 0.50%, 21/10/2027	92	0,01
100.000	EUR	FinecoBank Banca Fineco SpA, FRN, 4.63%, 23/02/2029	103	0,01
200.000	EUR	Genertel SpA, FRN, 4.25%, 14/12/2047	199	0,03
200.000	EUR	Iccrea Banca SpA, FRN, 2.13%, 17/01/2027	194	0,03
100.000	EUR	Iccrea Banca SpA, FRN, 6.38%, 20/09/2027	106	0,02
200.000	EUR	Iccrea Banca SpA, FRN, 6.88%, 20/01/2028	215	0,03
200.000	EUR	Iccrea Banca SpA, FRN, 4.25%, 05/02/2030	202	0,03
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.63%, 21/04/2025	245	0,03
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 2.13%, 26/05/2025	245	0,03
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.63%, 24/02/2026	283	0,04
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.00%, 19/05/2026	302	0,04
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 19/11/2026	234	0,03
175.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.38%, 29/08/2027	179	0,03
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.75%, 06/09/2027	310	0,04
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.75%, 16/03/2028	269	0,04
450.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.75%, 20/03/2028	420	0,06
400.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.75%, 04/07/2029	366	0,05
400.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.25%, 13/01/2030	434	0,06
300.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.88%, 19/05/2030	320	0,05
250.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.35%, 24/02/2031	212	0,03
400.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.13%, 29/08/2031	434	0,06
150.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033	166	0,02
550.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 5.00%, 08/03/2028	568	0,08
300.000	EUR	Iren SpA, 1.95%, 19/09/2025	292	0,04
100.000	EUR	Iren SpA, 0.88%, 14/10/2029	87	0,01
250.000	EUR	Iren SpA, 1.00%, 01/07/2030	214	0,03
100.000	EUR	Iren SpA, 0.25%, 17/01/2031	80	0,01
300.000	EUR	Iren SpA, 3.88%, 22/07/2032	304	0,04
200.000	EUR	Italgas SpA, 0.25%, 24/06/2025	192	0,03
200.000	EUR	Italgas SpA, 1.63%, 19/01/2027	190	0,03
100.000	EUR	Italgas SpA, 0.00%, 16/02/2028	88	0,01
100.000	EUR	Italgas SpA, 1.63%, 18/01/2029	93	0,01
300.000	EUR	Italgas SpA, 3.13%, 08/02/2029	295	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Italien (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Italgas SpA, 0.88%, 24/04/2030	172	0,02
200.000	EUR	Italgas SpA, 4.13%, 08/06/2032	206	0,03
300.000	EUR	Italgas SpA, 0.50%, 16/02/2033	229	0,03
250.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.13%, 23/04/2025	243	0,03
100.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.13%, 15/07/2025	97	0,01
150.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.88%, 15/01/2026	143	0,02
200.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.00%, 08/09/2027	184	0,03
500.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 4.75%, 14/03/2028	516	0,07
300.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 0.75%, 02/11/2028	272	0,04
100.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 4.63%, 07/02/2029	104	0,02
175.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 1.00%, 17/07/2029	157	0,02
150.000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, FRN, 3.88%, 04/07/2030	150	0,02
200.000	EUR	Pirelli & C SpA, FRN, 4.25%, 18/01/2028	204	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 0.00%, 15/08/2025	95	0,01
200.000	EUR	Snam SpA, 1.25%, 28/08/2025	194	0,03
450.000	EUR	Snam SpA, 0.88%, 25/10/2026	422	0,06
300.000	EUR	Snam SpA, 3.38%, 05/12/2026	299	0,04
100.000	EUR	Snam SpA, 1.38%, 25/10/2027	94	0,01
250.000	EUR	Snam SpA, 0.00%, 07/12/2028	215	0,03
200.000	EUR	Snam SpA, 4.00%, 27/11/2029	205	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 0.75%, 17/06/2030	85	0,01
250.000	EUR	Snam SpA, 0.63%, 30/06/2031	205	0,03
100.000	EUR	Snam SpA, 1.00%, 12/09/2034	77	0,01
200.000	EUR	Snam SpA, FRN, 0.75%, 20/06/2029	175	0,03
450.000	EUR	Snam SpA, FRN, 3.88%, 19/02/2034	454	0,06
100.000	EUR	Snam SpA, FRN, 1.25%, 20/06/2034	80	0,01
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.13%, 25/07/2025	191	0,03
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.00%, 10/04/2026	95	0,01
400.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.38%, 26/07/2027	375	0,05
400.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.00%, 11/10/2028	362	0,05
300.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.63%, 21/04/2029	303	0,04
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.38%, 23/06/2029	173	0,02
125.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.38%, 25/09/2030	103	0,02
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.50%, 17/01/2031	200	0,03
100.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.75%, 24/07/2032	81	0,01
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.88%, 24/07/2033	205	0,03
100.000	EUR	UniCredit SpA, 0.50%, 09/04/2025	97	0,01
300.000	EUR	UniCredit SpA, 0.33%, 19/01/2026	283	0,04
450.000	EUR	UniCredit SpA, 2.13%, 24/10/2026	436	0,06
350.000	EUR	UniCredit SpA, 1.80%, 20/01/2030	313	0,04
400.000	EUR	UniCredit SpA, 0.85%, 19/01/2031	333	0,05
100.000	EUR	UniCredit SpA, 1.63%, 18/01/2032	87	0,01
275.000	EUR	UniCredit SpA, 4.00%, 05/03/2034	279	0,04
205.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 1.25%, 16/06/2026	199	0,02
250.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 2.20%, 22/07/2027	241	0,03
200.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 5.85%, 15/11/2027	210	0,03
400.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 0.93%, 18/01/2028	373	0,05
300.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 4.80%, 17/01/2029	313	0,04
350.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 4.45%, 16/02/2029	357	0,05
250.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 0.80%, 05/07/2029	224	0,03
200.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 4.60%, 14/02/2030	209	0,03
275.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 4.30%, 23/01/2031	279	0,04
Italien - Gesamt			34.628	4,83
Japan (31. März 2023: 1,61 %)				
300.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 1.15%, 19/09/2025	289	0,04
200.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 0.34%, 19/04/2027	182	0,03
200.000	EUR	Asahi Group Holdings Ltd., 0.54%, 23/10/2028	176	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 2.61%, 08/09/2025	99	0,01
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 3.25%, 08/09/2030	100	0,01
200.000	EUR	East Japan Railway Co., 3.98%, 05/09/2032	211	0,03
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 1.85%, 13/04/2033	89	0,01
200.000	EUR	East Japan Railway Co., 0.77%, 15/09/2034	157	0,02
200.000	EUR	East Japan Railway Co., 1.10%, 15/09/2039	145	0,02
450.000	EUR	East Japan Railway Co., 4.11%, 22/02/2043	473	0,07
100.000	EUR	East Japan Railway Co., 4.39%, 05/09/2043	108	0,02
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0.85%, 19/07/2029	179	0,03
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 3.56%, 15/06/2032	205	0,03
200.000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FRN, 0.34%, 08/06/2027	186	0,03
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.21%, 07/10/2025	95	0,01
150.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.18%, 13/04/2026	141	0,02
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 1.63%, 08/04/2027	189	0,03
350.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 3.49%, 05/09/2027	350	0,05
400.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 1.60%, 10/04/2028	376	0,05
300.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.16%, 20/05/2028	308	0,04
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.40%, 06/09/2029	85	0,01
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.80%, 15/04/2030	86	0,01
400.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.61%, 28/08/2030	424	0,06
425.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.69%, 07/10/2030	356	0,05
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 2.10%, 08/04/2032	181	0,03
150.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.03%, 05/09/2032	155	0,02
100.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.84%, 12/04/2033	81	0,01
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 4.42%, 20/05/2033	211	0,03
200.000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., FRN, 0.47%, 06/09/2029	175	0,02
200.000	EUR	Nidec Corp., 0.05%, 30/03/2026	187	0,03
200.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 2.65%, 17/03/2026	195	0,03
200.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 3.20%, 17/09/2028	193	0,03
100.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.01%, 03/03/2025	97	0,01
100.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.08%, 13/12/2025	95	0,01
350.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.40%, 13/12/2028	308	0,04
350.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.34%, 03/03/2030	296	0,04
125.000	EUR	NTT Finance Corp., 3.36%, 12/03/2031	126	0,02
300.000	EUR	ORIX Corp., 1.92%, 20/04/2026	289	0,04
200.000	EUR	ORIX Corp., 4.48%, 01/06/2028	207	0,03
150.000	EUR	ORIX Corp., 3.78%, 29/05/2029	152	0,02
650.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1.55%, 15/06/2026	623	0,09
100.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1.41%, 14/06/2027	94	0,01
400.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.30%, 28/10/2027	359	0,05
250.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.63%, 23/10/2029	215	0,03
200.000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 4.49%, 12/06/2030	211	0,03
300.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 2.25%, 21/11/2026	291	0,04
200.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 0.75%, 09/07/2027	184	0,03
400.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 1.00%, 09/07/2029	356	0,05
200.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 1.38%, 09/07/2032	171	0,02
275.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 2.00%, 09/07/2040	217	0,03
400.000	EUR	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., FRN, 3.00%, 21/11/2030	391	0,06
Japan - Gesamt			11.069	1,55
Jersey (31. März 2023: 0,28 %)				
250.000	EUR	Aptiv plc, 1.50%, 10/03/2025	244	0,04
100.000	EUR	Aptiv plc, 1.60%, 15/09/2028	92	0,01
250.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.50%, 12/10/2027	242	0,03
400.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.50%, 11/02/2032	357	0,05
100.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.88%, 12/07/2032	88	0,01
100.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.13%, 08/10/2032	86	0,01
300.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., 1.88%, 14/03/2036	253	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Jersey (Fortsetzung)				
150.000	EUR	Heathrow Funding Ltd., FRN, 4.50%, 11/07/2035	158	0,02
		Jersey - Gesamt	1.520	0,21
Liechtenstein (31. März 2023: 0,05 %)				
300.000	EUR	Swiss Life Finance I Ltd., 3.25%, 31/08/2029	298	0,04
200.000	EUR	Swiss Life Finance I Ltd., 0.50%, 15/09/2031	162	0,02
		Liechtenstein - insgesamt	460	0,06
Luxemburg (31. März 2023: 4,78 %)				
200.000	EUR	Acef Holding SCA, REIT, 0.75%, 14/06/2028	174	0,02
200.000	EUR	Acef Holding SCA, REIT, 1.25%, 26/04/2030	169	0,02
300.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 0.38%, 15/04/2027	252	0,04
100.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 1.63%, 31/01/2028	83	0,01
200.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, 1.45%, 09/07/2028	164	0,02
200.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 1.63%, 15/04/2026 ¹	95	0,01
200.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.21%, 04/06/2026	190	0,03
125.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 0.33%, 13/08/2028	110	0,02
400.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 3.55%, 13/09/2029	404	0,06
200.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.21%, 12/02/2036	155	0,02
350.000	EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.34%, 13/08/2041	243	0,03
250.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 1.00%, 20/10/2026	229	0,03
250.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 1.25%, 26/04/2027	226	0,03
250.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 1.00%, 04/05/2028	216	0,03
400.000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, REIT, 3.63%, 29/10/2029	375	0,05
250.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0.75%, 17/04/2026	236	0,03
200.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.13%, 17/10/2028	181	0,03
300.000	EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.50%, 17/10/2031	257	0,04
100.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.75%, 12/09/2025	97	0,01
150.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.88%, 19/01/2026	145	0,02
300.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.75%, 25/03/2027	286	0,04
200.000	EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.63%, 03/07/2029	182	0,03
100.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 2.75%, 12/05/2026	91	0,01
200.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 1.50%, 27/01/2031	132	0,02
100.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, FRN, 1.63%, 23/04/2027	84	0,01
150.000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, FRN, 1.75%, 14/01/2030	109	0,02
125.000	EUR	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, REIT, FRN, 2.13%, 19/11/2025	119	0,02
400.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.20%, 18/03/2026	376	0,05
600.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.45%, 18/03/2028	541	0,08
550.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.75%, 18/09/2031	462	0,07
405.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.35%, 18/09/2039	308	0,04
100.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.80%, 18/09/2049	72	0,01
200.000	EUR	DH Europe Finance Sarl, 1.20%, 30/06/2027	188	0,03
300.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 4.00%, 06/07/2029	303	0,04
200.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 4.75%, 06/09/2030	209	0,03
200.000	EUR	Eurofins Scientific SE, 0.88%, 19/05/2031	163	0,02
250.000	EUR	GELF Bond Issuer I SA, REIT, 1.63%, 20/10/2026	238	0,03
200.000	EUR	GELF Bond Issuer I SA, REIT, 1.13%, 18/07/2029	172	0,02
300.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 1.38%, 03/08/2026	279	0,04
100.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 1.50%, 22/02/2027	92	0,01
300.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, 0.13%, 11/01/2028	254	0,04
100.000	EUR	Grand City Properties SA, REIT, FRN, 1.50%, 03/11/2026 ¹	64	0,01
200.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.63%, 07/04/2026	193	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Luxemburg (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.50%, 14/06/2027	95	0,01
250.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.13%, 01/12/2027	232	0,03
350.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.75%, 24/04/2028	332	0,05
200.000	EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, FRN, 4.88%, 21/11/2033	216	0,03
250.000	EUR	Helvetia Europe SA, FRN, 2.75%, 30/09/2041	221	0,03
400.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.32%, 15/12/2026	368	0,05
150.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.93%, 15/12/2031	125	0,02
300.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.38%, 09/04/2025	296	0,04
200.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.50%, 29/11/2026	186	0,03
200.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.13%, 19/07/2027	180	0,03
300.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.25%, 26/05/2028	287	0,04
150.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 1.75%, 29/08/2029	137	0,02
200.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.63%, 06/04/2030	169	0,02
250.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.50%, 03/09/2030	206	0,03
100.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.63%, 19/01/2033	78	0,01
200.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, FRN, 0.50%, 23/04/2031	162	0,02
350.000	EUR	John Deere Bank SA, 2.50%, 14/09/2026	344	0,05
150.000	EUR	John Deere Cash Management SA, 1.85%, 02/04/2028	144	0,02
200.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 2.20%, 02/04/2032	188	0,03
100.000	EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.65%, 13/06/2039	82	0,01
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.25%, 02/07/2025	144	0,02
250.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.00%, 15/10/2025	237	0,03
100.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.63%, 15/10/2025	98	0,01
300.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.13%, 07/03/2027	282	0,04
500.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.38%, 15/10/2028	442	0,06
450.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.00%, 15/10/2028	447	0,06
300.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.63%, 07/03/2031	270	0,04
350.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.00%, 02/07/2031	300	0,04
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.13%, 15/10/2031	149	0,02
200.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.75%, 15/10/2032	164	0,02
300.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.38%, 15/10/2034	301	0,04
600.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.25%, 07/03/2039	510	0,07
100.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.50%, 02/07/2039	76	0,01
275.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.38%, 15/10/2040	201	0,03
150.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.75%, 02/07/2049	105	0,02
225.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.63%, 15/10/2050	152	0,02
100.000	EUR	Mohawk Capital Finance SA, 1.75%, 12/06/2027	95	0,01
300.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 03/12/2025	284	0,04
250.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.13%, 01/04/2026	240	0,03
325.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 14/06/2026	304	0,04
75.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.88%, 29/03/2027	71	0,01
225.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.13%, 12/11/2027	204	0,03
250.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.50%, 13/12/2027	255	0,04
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.00%, 15/03/2028	101	0,01
275.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.25%, 14/06/2029	241	0,03
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.25%, 02/11/2029	91	0,01
150.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.50%, 17/01/2030	154	0,02
225.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.50%, 01/04/2030	207	0,03
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.25%, 15/01/2031	102	0,01
200.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.00%, 23/01/2031	200	0,03
200.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.25%, 29/03/2031	179	0,03
225.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.38%, 12/05/2032	185	0,03
150.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.00%, 03/03/2033	116	0,02
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.75%, 13/03/2033	106	0,02
75.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.63%, 14/02/2034	60	0,01
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.38%, 15/11/2034	103	0,02
425.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.50%, 29/03/2035	362	0,05
75.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.75%, 14/11/2035	79	0,01
400.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 3.25%, 23/01/2037	398	0,06

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Luxemburg (Fortsetzung)				
300.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 1.75%, 02/11/2037	253	0,04
100.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.38%, 03/12/2040	65	0,01
175.000	EUR	Nestle Finance International Ltd., 0.88%, 14/06/2041	123	0,02
150.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.63%, 09/11/2026	145	0,02
100.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.13%, 30/09/2027	94	0,01
300.000	EUR	Novartis Finance SA, 0.63%, 20/09/2028	271	0,04
250.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.38%, 14/08/2030	227	0,03
100.000	EUR	Novartis Finance SA, 1.70%, 14/08/2038	85	0,01
650.000	EUR	Novartis Finance SA, FRN, 0.00%, 23/09/2028	570	0,08
300.000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 3.63%, 07/03/2030	298	0,04
300.000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 1.63%, 17/06/2032	253	0,04
300.000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 4.63%, 21/02/2035	315	0,04
200.000	EUR	Repsol Europe Finance Sarl, FRN, 0.38%, 06/07/2029	173	0,03
200.000	EUR	Repsol Europe Finance Sarl, FRN, 0.88%, 06/07/2033	159	0,02
100.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.25%, 23/03/2026	95	0,01
300.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.88%, 23/03/2030	271	0,04
100.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 0.50%, 22/09/2031	79	0,01
150.000	EUR	SES SA, 1.63%, 22/03/2026	144	0,02
300.000	EUR	SES SA, 0.88%, 04/11/2027	271	0,04
250.000	EUR	SES SA, 2.00%, 02/07/2028	234	0,03
100.000	EUR	SES SA, 3.50%, 14/01/2029	98	0,01
200.000	EUR	Simon International Finance SCA, REIT, 1.13%, 19/03/2033	161	0,02
100.000	EUR	Swiss Re Finance Luxembourg SA, FRN, 2.53%, 30/04/2050	92	0,01
300.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.00%, 16/09/2025	300	0,04
400.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.13%, 22/11/2025	402	0,06
100.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.50%, 23/11/2026	102	0,01
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.25%, 16/05/2028	204	0,03
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.75%, 24/03/2029	174	0,02
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 3.75%, 27/03/2030	200	0,03
200.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 1.25%, 24/03/2033	162	0,02
100.000	EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.00%, 16/02/2029	86	0,01
200.000	EUR	Tyco Electronics Group SA, FRN, 0.00%, 14/02/2025	194	0,03
200.000	EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.25%, 02/11/2026	189	0,03
150.000	EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.10%, 09/11/2027	138	0,02
		Luxemburg - Gesamt	27.608	3,86
		Mexiko (31. März 2023: 0,04 %)		
100.000	EUR	America Movil SAB de CV, 0.75%, 26/06/2027	92	0,01
100.000	EUR	America Movil SAB de CV, 2.13%, 10/03/2028	95	0,02
		Mexiko - Gesamt	187	0,03
		Niederlande (31. März 2023: 16,88 %)		
200.000	EUR	ABB Finance BV, 3.25%, 16/01/2027	201	0,03
100.000	EUR	ABB Finance BV, 3.13%, 15/01/2029	100	0,01
200.000	EUR	ABB Finance BV, 0.00%, 19/01/2030	167	0,02
300.000	EUR	ABB Finance BV, 3.38%, 16/01/2031	304	0,04
200.000	EUR	ABB Finance BV, 3.38%, 15/01/2034	201	0,03
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.00%, 16/04/2025	293	0,04
400.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.75%, 20/04/2025	401	0,06
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.88%, 22/04/2025	195	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.25%, 28/05/2025	195	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.63%, 10/01/2026	201	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 15/04/2026	190	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.88%, 21/12/2026	203	0,03
600.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.60%, 15/01/2027	555	0,08
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 2.38%, 01/06/2027	194	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
400.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.00%, 16/01/2028	407	0,06
400.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.38%, 20/10/2028	414	0,06
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 23/09/2029	257	0,04
300.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.25%, 21/02/2030	312	0,04
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.88%, 15/01/2032	203	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.00%, 01/06/2032	196	0,03
400.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.00%, 02/06/2033	333	0,05
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.25%, 20/01/2034	163	0,02
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.50%, 21/11/2034	215	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, FRN, 5.13%, 22/02/2033	205	0,03
200.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, FRN, 5.50%, 21/09/2033	209	0,03
100.000	EUR	Achmea BV, 3.63%, 29/11/2025	100	0,01
150.000	EUR	Achmea BV, 1.50%, 26/05/2027	141	0,02
100.000	EUR	Achmea BV, FRN, 6.75%, 26/12/2043	111	0,02
200.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.13%, 21/09/2028	176	0,02
100.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.50%, 21/09/2031	81	0,01
250.000	EUR	Adecco International Financial Services BV, FRN, 1.00%, 21/03/2082	222	0,03
300.000	EUR	AGCO International Holdings BV, 0.80%, 06/10/2028	264	0,04
100.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 1.00%, 17/01/2028	88	0,01
125.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 1.13%, 11/01/2029	107	0,02
100.000	EUR	Akelius Residential Property Financing BV, REIT, 0.75%, 22/02/2030	80	0,01
100.000	EUR	Akzo Nobel NV, 1.50%, 28/03/2028	93	0,01
150.000	EUR	Akzo Nobel NV, 1.63%, 14/04/2030	135	0,02
100.000	EUR	Akzo Nobel NV, 2.00%, 28/03/2032	90	0,01
150.000	EUR	Akzo Nobel NV, 4.00%, 24/05/2033	155	0,02
100.000	EUR	Alcon Finance BV, 2.38%, 31/05/2028	97	0,01
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.88%, 15/01/2026	192	0,03
300.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.00%, 22/11/2026	277	0,04
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 3.00%, 13/03/2028	200	0,03
200.000	EUR	Allianz Finance II BV, 1.50%, 15/01/2030	184	0,03
300.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.50%, 14/01/2031	255	0,04
100.000	EUR	Allianz Finance II BV, 1.38%, 21/04/2031	90	0,01
100.000	EUR	Allianz Finance II BV, 0.50%, 22/11/2033	79	0,01
200.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.38%, 08/03/2028	186	0,03
350.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 3.38%, 08/03/2029	351	0,05
150.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.63%, 08/03/2031	135	0,02
475.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 3.50%, 08/03/2032	479	0,07
200.000	EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.88%, 08/03/2034	174	0,02
300.000	EUR	Arcadis NV, 4.88%, 28/02/2028	311	0,04
100.000	EUR	ASML Holding NV, 3.50%, 06/12/2025	100	0,01
350.000	EUR	ASML Holding NV, 1.38%, 07/07/2026	336	0,05
100.000	EUR	ASML Holding NV, 1.63%, 28/05/2027	96	0,01
200.000	EUR	ASML Holding NV, 0.63%, 07/05/2029	179	0,03
375.000	EUR	ASML Holding NV, 0.25%, 25/02/2030	322	0,05
100.000	EUR	ASML Holding NV, 2.25%, 17/05/2032	95	0,01
200.000	EUR	ASR Nederland NV, 3.63%, 12/12/2028	200	0,03
200.000	EUR	ASR Nederland NV, FRN, 7.00%, 07/12/2043	231	0,03
250.000	EUR	ASR Nederland NV, FRN, 5.13%, 29/09/2045	253	0,04
350.000	EUR	ASR Nederland NV, FRN, 3.38%, 02/05/2049	330	0,05
100.000	EUR	Athora Netherlands NV, FRN, 2.25%, 15/07/2031	92	0,01
150.000	EUR	Athora Netherlands NV, FRN, 5.38%, 31/08/2032	147	0,02
100.000	EUR	BASF Finance Europe NV, 0.75%, 10/11/2026	95	0,01
500.000	EUR	Bayer Capital Corp. BV, 1.50%, 26/06/2026	475	0,07
300.000	EUR	Bayer Capital Corp. BV, 2.13%, 15/12/2029	271	0,04
50.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 21/01/2025	49	0,01
300.000	EUR	BMW Finance NV, 3.50%, 06/04/2025	300	0,04
100.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 29/08/2025	97	0,01
250.000	EUR	BMW Finance NV, 0.00%, 11/01/2026	236	0,04
400.000	EUR	BMW Finance NV, 1.13%, 22/05/2026	384	0,05

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.75%, 13/07/2026	142	0,02
300.000	EUR	BMW Finance NV, 3.25%, 22/11/2026	301	0,04
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.38%, 14/01/2027	139	0,02
150.000	EUR	BMW Finance NV, 0.38%, 24/09/2027	137	0,02
200.000	EUR	BMW Finance NV, 1.13%, 10/01/2028	186	0,03
200.000	EUR	BMW Finance NV, 1.00%, 22/05/2028	184	0,03
550.000	EUR	BMW Finance NV, 1.50%, 06/02/2029	509	0,07
200.000	EUR	BMW Finance NV, 3.25%, 22/07/2030	203	0,03
100.000	EUR	BMW Finance NV, 0.88%, 14/01/2032	85	0,01
100.000	EUR	BMW Finance NV, 0.20%, 11/01/2033	78	0,01
300.000	EUR	BMW Finance NV, 3.63%, 22/05/2035	306	0,04
300.000	EUR	BNI Finance BV, 3.88%, 01/12/2030	309	0,04
200.000	EUR	BP Capital Markets BV, 3.77%, 12/05/2030	205	0,03
200.000	EUR	BP Capital Markets BV, 4.32%, 12/05/2035	212	0,03
300.000	EUR	BP Capital Markets BV, 0.93%, 04/12/2040	196	0,03
200.000	EUR	BP Capital Markets BV, 1.47%, 21/09/2041	141	0,02
200.000	EUR	Brenntag Finance BV, 1.13%, 27/09/2025	193	0,03
100.000	EUR	Brenntag Finance BV, 0.50%, 06/10/2029	85	0,01
100.000	EUR	Citycon Treasury BV, REIT, 6.50%, 08/03/2029	101	0,01
300.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 2.75%, 23/09/2025	296	0,04
150.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.00%, 14/05/2027	140	0,02
250.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 3.38%, 27/02/2028	251	0,04
200.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 0.63%, 21/11/2029	173	0,02
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.63%, 14/05/2031	89	0,01
300.000	EUR	Coloplast Finance BV, 2.25%, 19/05/2027	290	0,04
300.000	EUR	Coloplast Finance BV, 2.75%, 19/05/2030	289	0,04
100.000	EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 1.50%, 05/09/2028	94	0,01
100.000	EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 3.00%, 08/03/2030	99	0,01
350.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.13%, 14/07/2025	353	0,05
860.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.25%, 23/03/2026	829	0,12
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.25%, 30/10/2026	185	0,03
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 3.91%, 03/11/2026	203	0,03
400.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.38%, 03/02/2027	382	0,05
300.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.00%, 10/01/2030	308	0,04
300.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.13%, 07/05/2031	256	0,04
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.63%, 25/02/2033	159	0,02
300.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 3.82%, 26/07/2034	307	0,04
500.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 0.38%, 01/12/2027	460	0,06
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 4.63%, 27/01/2028	206	0,03
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 0.88%, 05/05/2028	184	0,03
500.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 4.23%, 25/04/2029	513	0,07
200.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 3.88%, 30/11/2032	199	0,03
300.000	EUR	CRH Funding BV, 1.63%, 05/05/2030	272	0,04
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.50%, 21/06/2025	95	0,01
300.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.88%, 20/01/2026	283	0,04
200.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/09/2026	184	0,03
200.000	EUR	CTP NV, REIT, 1.25%, 21/06/2029	172	0,02
300.000	EUR	CTP NV, REIT, 4.75%, 05/02/2030	304	0,04
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 1.50%, 27/09/2031	82	0,01
100.000	EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.25%, 06/04/2025	98	0,01
400.000	EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.63%, 06/04/2027	380	0,05
300.000	EUR	Daimler Truck International Finance BV, 3.88%, 19/06/2029	307	0,04
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.38%, 01/12/2025	97	0,01
200.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.13%, 22/05/2026	192	0,03
200.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.38%, 30/01/2027	191	0,03
150.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 3.25%, 17/01/2028	152	0,02
400.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.50%, 03/04/2028	376	0,05
300.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.00%, 01/12/2029	284	0,04
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 4.50%, 28/10/2030	108	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, FRN, 7.50%, 24/01/2033	130	0,02
200.000	EUR	Diageo Capital BV, 0.13%, 28/09/2028	176	0,02
100.000	EUR	Diageo Capital BV, 1.50%, 08/06/2029	93	0,01
200.000	EUR	Diageo Capital BV, 1.88%, 08/06/2034	176	0,03
300.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 0.63%, 15/07/2025	288	0,04
200.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.50%, 15/03/2030	174	0,02
200.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.25%, 01/02/2031	166	0,02
250.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.00%, 15/01/2032	198	0,03
100.000	EUR	Digital Intrepid Holding BV, REIT, 0.63%, 15/07/2031	78	0,01
150.000	EUR	Digital Intrepid Holding BV, REIT, 1.38%, 18/07/2032	122	0,02
100.000	EUR	DSM BV, 1.00%, 09/04/2025	98	0,01
100.000	EUR	DSM BV, 0.25%, 23/06/2028	89	0,01
100.000	EUR	DSM BV, 0.63%, 23/06/2032	82	0,01
300.000	EUR	DSM BV, FRN, 0.75%, 28/09/2026	283	0,04
200.000	EUR	DSV Finance BV, 1.38%, 16/03/2030	179	0,03
100.000	EUR	DSV Finance BV, 0.50%, 03/03/2031	82	0,01
150.000	EUR	DSV Finance BV, 0.75%, 05/07/2033	118	0,02
150.000	EUR	DSV Finance BV, 0.88%, 17/09/2036	110	0,02
225.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.00%, 13/04/2025	219	0,03
320.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.63%, 30/05/2026	310	0,04
175.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.25%, 19/10/2027	164	0,02
280.000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.50%, 31/07/2029	256	0,04
100.000	EUR	E.ON International Finance BV, 5.75%, 14/02/2033	116	0,02
550.000	EUR	easyJet FinCo. BV, 1.88%, 03/03/2028	515	0,07
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.97%, 27/01/2025	197	0,03
150.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.50%, 21/07/2025	146	0,02
300.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.38%, 01/06/2026	288	0,04
200.000	EUR	Enel Finance International NV, 1.13%, 16/09/2026	190	0,03
500.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.25%, 17/11/2025	474	0,07
325.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.00%, 28/05/2026	302	0,04
350.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.00%, 17/06/2027	315	0,05
200.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.38%, 17/06/2027	182	0,03
300.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 3.38%, 23/07/2028	301	0,04
300.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 3.88%, 09/03/2029	307	0,04
300.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.38%, 28/05/2029	260	0,04
350.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.50%, 17/06/2030	296	0,04
350.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.88%, 17/01/2031	297	0,04
250.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 4.00%, 20/02/2031	258	0,04
175.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.88%, 28/09/2034	133	0,02
200.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 1.13%, 17/10/2034	157	0,02
275.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 1.25%, 17/01/2035	217	0,03
300.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 3.88%, 23/01/2035	302	0,04
250.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.88%, 17/06/2036	180	0,03
125.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 4.50%, 20/02/2043	131	0,02
300.000	EUR	Essity Capital BV, 3.00%, 21/09/2026	297	0,04
250.000	EUR	Essity Capital BV, 0.25%, 15/09/2029	220	0,03
200.000	EUR	Euronext NV, 0.13%, 17/05/2026	186	0,03
200.000	EUR	Euronext NV, 1.13%, 12/06/2029	180	0,03
200.000	EUR	Euronext NV, 0.75%, 17/05/2031	168	0,02
200.000	EUR	Euronext NV, 1.50%, 17/05/2041	149	0,02
300.000	EUR	EXOR NV, 1.75%, 18/01/2028	284	0,04
100.000	EUR	EXOR NV, 2.25%, 29/04/2030	93	0,01
100.000	EUR	EXOR NV, 0.88%, 19/01/2031	85	0,01
400.000	EUR	EXOR NV, 1.75%, 14/10/2034	331	0,05
200.000	EUR	Ferrovial SE, FRN, 4.38%, 13/09/2030	208	0,03
200.000	EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.63%, 22/04/2032	177	0,03
300.000	EUR	Givaudan Finance Europe BV, 4.13%, 28/11/2033	316	0,04
200.000	EUR	Global Switch Finance BV, 1.38%, 07/10/2030	185	0,03
400.000	EUR	GSK Capital BV, 3.00%, 28/11/2027	398	0,06

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
150.000	EUR	GSK Capital BV, 3.13%, 28/11/2032	149	0,02
100.000	EUR	H&M Finance BV, 4.88%, 25/10/2031	106	0,02
300.000	EUR	H&M Finance BV, FRN, 0.25%, 25/08/2029	250	0,03
200.000	EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.25%, 29/03/2026	191	0,03
400.000	EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.75%, 29/03/2030	365	0,05
200.000	EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 2.13%, 29/03/2034	176	0,02
150.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 1.38%, 03/03/2027	128	0,02
350.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 1.00%, 13/04/2028	275	0,04
350.000	EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, REIT, 1.63%, 13/10/2031	245	0,03
150.000	EUR	Heineken NV, 1.63%, 30/03/2025	147	0,02
150.000	EUR	Heineken NV, 2.88%, 04/08/2025	149	0,02
200.000	EUR	Heineken NV, 1.00%, 04/05/2026	191	0,03
300.000	EUR	Heineken NV, 3.63%, 15/11/2026	302	0,04
150.000	EUR	Heineken NV, 1.38%, 29/01/2027	142	0,02
100.000	EUR	Heineken NV, 1.25%, 17/03/2027	95	0,01
300.000	EUR	Heineken NV, 1.50%, 03/10/2029	275	0,04
150.000	EUR	Heineken NV, 2.25%, 30/03/2030	142	0,02
400.000	EUR	Heineken NV, 3.88%, 23/09/2030	416	0,06
150.000	EUR	Heineken NV, 1.75%, 17/03/2031	136	0,02
200.000	EUR	Heineken NV, 1.25%, 07/05/2033	168	0,02
200.000	EUR	Heineken NV, 4.13%, 23/03/2035	212	0,03
200.000	EUR	Heineken NV, 1.75%, 07/05/2040	159	0,02
100.000	EUR	Iberdrola International BV, 0.38%, 15/09/2025	96	0,01
300.000	EUR	Iberdrola International BV, 1.13%, 21/04/2026	288	0,04
400.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.87%, 28/01/2026 ¹	381	0,05
400.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.45%, 11/09/2026 ¹	368	0,05
300.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 2.25%, 28/01/2029 ¹	269	0,04
300.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.83%, 08/09/2029 ¹	258	0,04
100.000	EUR	IMCD NV, 2.13%, 31/03/2027	95	0,01
200.000	EUR	IMCD NV, 4.88%, 18/09/2028	208	0,03
200.000	EUR	ING Bank NV, 4.13%, 02/10/2026	203	0,03
200.000	EUR	ING Groep NV, 2.13%, 10/01/2026	195	0,03
500.000	EUR	ING Groep NV, 1.38%, 11/01/2028	466	0,07
600.000	EUR	ING Groep NV, 2.00%, 20/09/2028	562	0,08
500.000	EUR	ING Groep NV, 2.50%, 15/11/2030	474	0,07
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 23/05/2026	294	0,04
500.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.25%, 16/02/2027	477	0,07
600.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.88%, 14/11/2027	618	0,09
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.38%, 29/09/2028	89	0,01
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.25%, 18/02/2029	350	0,04
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.50%, 23/05/2029	412	0,06
500.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 3.88%, 12/08/2029	503	0,07
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.25%, 01/02/2030	339	0,05
100.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.00%, 13/11/2030	95	0,01
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.88%, 29/11/2030	172	0,02
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.75%, 16/02/2031	270	0,04
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 26/05/2031	384	0,05
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.88%, 09/06/2032	271	0,04
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 1.00%, 16/11/2032	180	0,02
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.13%, 24/08/2033	200	0,03
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 5.25%, 14/11/2033	222	0,03
400.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.75%, 23/05/2034	431	0,06
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.00%, 12/02/2035	204	0,03
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 5.00%, 20/02/2035	206	0,03
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.63%, 30/04/2025	98	0,01
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.75%, 25/06/2026	96	0,01
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.50%, 17/04/2027	97	0,01
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.00%, 20/12/2027	183	0,03
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.00%, 18/05/2028	94	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
500.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.50%, 25/06/2029	477	0,07
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 1.00%, 14/07/2031	85	0,01
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 5.00%, 12/06/2033	216	0,03
100.000	EUR	JAB Holdings BV, 3.38%, 17/04/2035	96	0,01
200.000	EUR	JAB Holdings BV, 2.25%, 19/12/2039	154	0,02
100.000	EUR	JAB Holdings BV, FRN, 4.75%, 29/06/2032	106	0,01
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.24%, 16/01/2025	97	0,01
200.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.00%, 16/01/2026	187	0,03
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.63%, 09/02/2028	89	0,01
200.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.50%, 16/01/2029	173	0,02
300.000	EUR	JDE Peet's NV, 4.13%, 23/01/2030	305	0,04
100.000	EUR	JDE Peet's NV, 1.13%, 16/06/2033	79	0,01
200.000	EUR	JDE Peet's NV, 4.50%, 23/01/2034	208	0,03
200.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.25%, 26/06/2025	192	0,03
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.13%, 19/03/2026	96	0,01
200.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.75%, 02/04/2027	192	0,03
300.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 3.50%, 04/04/2028	303	0,04
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 3.38%, 11/03/2031	101	0,01
350.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, FRN, 0.38%, 18/03/2030	297	0,04
200.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, FRN, 3.88%, 11/03/2036	204	0,03
200.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 0.63%, 09/04/2025	194	0,03
100.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 1.13%, 11/09/2028	91	0,01
200.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 3.88%, 03/07/2031	206	0,03
100.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 0.88%, 14/12/2032	81	0,01
400.000	EUR	Koninklijke KPN NV, 3.88%, 16/02/2036	405	0,06
200.000	EUR	Koninklijke KPN NV, FRN, 0.88%, 15/11/2033	159	0,02
300.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 2.13%, 06/05/2025	294	0,04
325.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.25%, 23/02/2026	304	0,04
350.000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.25%, 07/09/2026	323	0,05
100.000	EUR	Linde Finance BV, 0.25%, 19/05/2027	91	0,01
150.000	EUR	Linde Finance BV, 1.00%, 20/04/2028	139	0,02
100.000	EUR	Linde Finance BV, 0.55%, 19/05/2032	81	0,01
200.000	EUR	LKQ Dutch Bond BV, 4.13%, 13/03/2031	203	0,03
200.000	EUR	Louis Dreyfus Co. Finance BV, 1.63%, 28/04/2028	185	0,03
100.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.00%, 06/04/2025	96	0,01
500.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 4.13%, 29/09/2026	508	0,07
200.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.25%, 06/04/2028	178	0,03
125.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 4.23%, 29/09/2030	131	0,02
100.000	EUR	Lseg Netherlands BV, 0.75%, 06/04/2033	80	0,01
400.000	EUR	LYB International Finance II BV, 0.88%, 17/09/2026	374	0,05
100.000	EUR	LYB International Finance II BV, 1.63%, 17/09/2031	86	0,01
150.000	EUR	Madrilena Red de Gas Finance BV, 2.25%, 11/04/2029	133	0,02
200.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.63%, 07/04/2025	198	0,03
200.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.40%, 13/04/2025	199	0,03
250.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.00%, 11/11/2025	241	0,03
300.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.50%, 09/03/2026	291	0,04
650.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.50%, 30/05/2026	653	0,09
300.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.38%, 26/06/2026	288	0,04
225.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.00%, 22/08/2026	219	0,03
150.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.38%, 08/11/2026	140	0,02
225.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.50%, 09/02/2027	215	0,03
300.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.63%, 06/05/2027	279	0,04
125.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.00%, 10/07/2027	124	0,02
425.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.70%, 30/05/2031	441	0,06
350.000	EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.25%, 10/01/2032	349	0,05
400.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.00%, 22/09/2026	369	0,05
100.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.25%, 09/09/2029	86	0,01
400.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.38%, 22/09/2029	343	0,05
100.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.88%, 01/10/2031	84	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.63%, 09/09/2032	161	0,02
250.000	EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 1.25%, 09/09/2041	176	0,03
100.000	EUR	Nationale-Niederlanden Bank NV (The) Netherlands, 0.50%, 21/09/2028	88	0,01
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.38%, 21/01/2025	98	0,01
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 0.88%, 15/05/2025	97	0,01
300.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.25%, 15/01/2026	288	0,04
400.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.25%, 19/04/2026	382	0,05
300.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.38%, 19/01/2027	283	0,04
100.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.50%, 29/01/2028	93	0,01
500.000	EUR	Naturgy Finance BV, 0.75%, 28/11/2029	437	0,06
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, 3.38%, 14/07/2027	97	0,01
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, 2.00%, 20/01/2030	86	0,01
100.000	EUR	NE Property BV, REIT, FRN, 1.88%, 09/10/2026	93	0,01
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.88%, 08/07/2025	96	0,01
300.000	EUR	NIBC Bank NV, 6.38%, 01/12/2025	311	0,04
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.25%, 09/09/2026	92	0,01
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 0.88%, 24/06/2027	92	0,01
100.000	EUR	NIBC Bank NV, 6.00%, 16/11/2028	108	0,02
200.000	EUR	NN Group NV, 1.63%, 01/06/2027	190	0,03
400.000	EUR	NN Group NV, 0.88%, 23/11/2031	340	0,05
200.000	EUR	NN Group NV, FRN, 4.50%, 15/01/2026 ¹	200	0,03
100.000	EUR	NN Group NV, FRN, 5.25%, 01/03/2043	104	0,01
126.000	EUR	NN Group NV, FRN, 6.00%, 03/11/2043	137	0,02
450.000	EUR	NN Group NV, FRN, 4.63%, 13/01/2048	454	0,06
200.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 1.13%, 30/09/2027	188	0,03
200.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.13%, 04/06/2028	178	0,03
200.000	EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 1.38%, 31/03/2030	184	0,03
90.000	EUR	OCI NV, 3.63%, 15/10/2025	89	0,01
100.000	EUR	PACCAR Financial Europe BV, 0.00%, 01/03/2026	94	0,01
200.000	EUR	PACCAR Financial Europe BV, 3.38%, 15/05/2026	199	0,03
300.000	EUR	Pluxee NV, 3.75%, 04/09/2032	300	0,04
150.000	EUR	PostNL NV, 0.63%, 23/09/2026	138	0,02
100.000	EUR	Prosus NV, 1.21%, 19/01/2026	95	0,01
125.000	EUR	Prosus NV, 1.54%, 03/08/2028	111	0,02
300.000	EUR	Prosus NV, 1.29%, 13/07/2029	254	0,04
200.000	EUR	Prosus NV, 2.09%, 19/01/2030	174	0,02
250.000	EUR	Prosus NV, 2.03%, 03/08/2032	201	0,03
100.000	EUR	Prosus NV, 1.99%, 13/07/2033	77	0,01
100.000	EUR	Prosus NV, 2.78%, 19/01/2034	81	0,01
200.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.38%, 19/05/2026	187	0,03
200.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.75%, 19/05/2030	171	0,02
550.000	EUR	RELX Finance BV, 1.50%, 13/05/2027	524	0,07
200.000	EUR	RELX Finance BV, 0.50%, 10/03/2028	180	0,03
100.000	EUR	RELX Finance BV, 3.75%, 12/06/2031	103	0,01
100.000	EUR	RELX Finance BV, 0.88%, 10/03/2032	84	0,01
100.000	EUR	RELX Finance BV, 3.38%, 20/03/2033	100	0,01
200.000	EUR	Ren Finance BV, 1.75%, 18/01/2028	188	0,03
200.000	EUR	Ren Finance BV, 0.50%, 16/04/2029	175	0,02
250.000	EUR	Ren Finance BV, 3.50%, 27/02/2032	249	0,04
100.000	EUR	Rentokil Initial Finance BV, 3.88%, 27/06/2027	101	0,01
200.000	EUR	Rentokil Initial Finance BV, 4.38%, 27/06/2030	210	0,03
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.00%, 15/12/2025	195	0,03
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.25%, 10/12/2026	98	0,01
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, 0.25%, 02/08/2027	90	0,01
300.000	EUR	Repsol International Finance BV, 2.63%, 15/04/2030	291	0,04
150.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 3.75%, 03/11/2026 ¹	147	0,02
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 2.50%, 22/12/2026 ¹	189	0,03
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 4.25%, 09/11/2028 ¹	197	0,03
100.000	EUR	Robert Bosch Investment Nederland BV, 2.63%, 24/05/2028	98	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
300.000	EUR	Roche Finance Europe BV, 3.31%, 04/12/2027	303	0,04
325.000	EUR	Roche Finance Europe BV, 3.20%, 27/08/2029	329	0,05
200.000	EUR	Roche Finance Europe BV, 3.36%, 27/02/2035	204	0,03
125.000	EUR	Roche Finance Europe BV, 3.59%, 04/12/2036	130	0,02
225.000	EUR	Sagax Euro Mtn NL BV, REIT, 1.00%, 17/05/2029	193	0,03
300.000	EUR	Sandoz Finance BV, 3.97%, 17/04/2027	305	0,04
300.000	EUR	Sandoz Finance BV, 4.50%, 17/11/2033	319	0,05
300.000	EUR	Sartorius Finance BV, 4.50%, 14/09/2032	317	0,04
300.000	EUR	Sartorius Finance BV, 4.88%, 14/09/2035	323	0,05
100.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 1.38%, 28/10/2026	95	0,01
300.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 0.25%, 15/10/2027	271	0,04
500.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 0.50%, 15/10/2031	410	0,06
200.000	EUR	Schlumberger Finance BV, 2.00%, 06/05/2032	182	0,03
300.000	EUR	SGS Nederland Holding BV, 0.13%, 21/04/2027	272	0,04
400.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.38%, 15/02/2025	389	0,05
300.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.88%, 15/09/2025	293	0,04
300.000	EUR	Shell International Finance BV, 2.50%, 24/03/2026	296	0,04
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.63%, 20/01/2027	192	0,03
100.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.13%, 08/11/2027	90	0,01
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.50%, 07/04/2028	187	0,03
400.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.25%, 12/05/2028	370	0,05
425.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.75%, 15/08/2028	384	0,05
325.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.50%, 08/11/2031	266	0,04
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.88%, 07/04/2032	180	0,03
200.000	EUR	Shell International Finance BV, 1.25%, 11/11/2032	170	0,02
250.000	EUR	Shell International Finance BV, 0.88%, 08/11/2039	171	0,02
300.000	EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.00%, 05/04/2026	299	0,04
200.000	EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.25%, 05/04/2029	202	0,03
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.00%, 20/02/2026	188	0,03
500.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.38%, 05/06/2026	470	0,07
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.63%, 25/02/2027	93	0,01
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.00%, 06/09/2027	188	0,03
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.50%, 08/09/2027	98	0,01
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.90%, 28/02/2028	92	0,01
250.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.88%, 10/03/2028	250	0,04
500.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.00%, 22/11/2028	501	0,07
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.25%, 20/02/2029	176	0,02
175.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.13%, 05/09/2029	153	0,02
400.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.00%, 25/02/2030	357	0,05
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.38%, 06/09/2030	182	0,03
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.75%, 09/09/2030	197	0,03
300.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.25%, 28/02/2031	268	0,04
300.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.38%, 24/08/2031	305	0,04
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.50%, 20/02/2032	82	0,01
300.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.13%, 22/05/2032	300	0,04
400.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.00%, 08/09/2033	395	0,06
450.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.50%, 05/09/2034	345	0,05
300.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.25%, 25/02/2035	246	0,03
100.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.50%, 24/02/2036	102	0,01
400.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.38%, 22/02/2037	400	0,06
150.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.75%, 28/02/2039	122	0,02
200.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.63%, 24/02/2043	202	0,03
400.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.63%, 22/02/2044	406	0,06
200.000	EUR	Signify NV, 2.38%, 11/05/2027	193	0,03
350.000	EUR	Sika Capital BV, 3.75%, 03/11/2026	353	0,05
100.000	EUR	Sika Capital BV, 0.88%, 29/04/2027	93	0,01
300.000	EUR	Sika Capital BV, 3.75%, 03/05/2030	307	0,04
100.000	EUR	Sika Capital BV, 1.50%, 29/04/2031	89	0,01
100.000	EUR	Stellantis NV, 2.00%, 20/03/2025	98	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
400.000	EUR	Stellantis NV, 3.88%, 05/01/2026	402	0,06
300.000	EUR	Stellantis NV, 2.75%, 15/05/2026	296	0,04
400.000	EUR	Stellantis NV, 0.63%, 30/03/2027	369	0,05
250.000	EUR	Stellantis NV, 4.50%, 07/07/2028	261	0,04
300.000	EUR	Stellantis NV, 0.75%, 18/01/2029	266	0,04
100.000	EUR	Stellantis NV, 1.13%, 18/09/2029	89	0,01
300.000	EUR	Stellantis NV, 4.38%, 14/03/2030	315	0,04
100.000	EUR	Stellantis NV, 3.50%, 19/09/2030	100	0,01
650.000	EUR	Stellantis NV, 4.25%, 16/06/2031	677	0,09
200.000	EUR	Stellantis NV, 2.75%, 01/04/2032	189	0,03
275.000	EUR	Stellantis NV, 1.25%, 20/06/2033	224	0,03
150.000	EUR	Sudzucker International Finance BV, 1.00%, 28/11/2025	144	0,02
100.000	EUR	Sudzucker International Finance BV, FRN, 5.13%, 31/10/2027	104	0,01
100.000	EUR	Technip Energies NV, 1.13%, 28/05/2028	91	0,01
100.000	EUR	Telefonica Europe BV, 5.88%, 14/02/2033	118	0,02
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.00%, 18/11/2025	95	0,01
450.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.80%, 18/10/2030	388	0,05
400.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.13%, 18/10/2033	331	0,05
300.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.63%, 18/10/2041	226	0,03
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 2.00%, 18/10/2051	72	0,01
200.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.00%, 27/10/2025	190	0,03
100.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3.38%, 13/01/2026	100	0,01
300.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 4.00%, 02/04/2027	305	0,04
101.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3.50%, 13/01/2028	102	0,01
300.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.00%, 25/02/2028	266	0,04
150.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3.13%, 11/07/2029	149	0,02
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.88%, 31/07/2025	97	0,01
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.75%, 28/02/2026	143	0,02
200.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.13%, 12/02/2027	189	0,03
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.00%, 14/02/2027	142	0,02
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.13%, 29/04/2028	139	0,02
350.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.75%, 16/11/2028	331	0,05
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.38%, 31/07/2029	92	0,01
500.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.75%, 25/03/2030	466	0,07
100.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.38%, 04/09/2030	90	0,01
300.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.25%, 28/02/2031	266	0,04
250.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.25%, 15/02/2032	253	0,04
200.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.63%, 12/02/2033	177	0,03
150.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 2.25%, 16/05/2034	139	0,02
300.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.50%, 15/02/2037	305	0,04
100.000	EUR	Universal Music Group NV, 3.00%, 30/06/2027	99	0,01
200.000	EUR	Universal Music Group NV, 4.00%, 13/06/2031	207	0,03
100.000	EUR	Universal Music Group NV, 3.75%, 30/06/2032	102	0,01
500.000	EUR	Upjohn Finance BV, 1.36%, 23/06/2027	463	0,07
250.000	EUR	Upjohn Finance BV, 1.91%, 23/06/2032	211	0,03
200.000	EUR	Vestas Wind Systems Finance BV, FRN, 1.50%, 15/06/2029	182	0,03
200.000	EUR	Vestas Wind Systems Finance BV, FRN, 2.00%, 15/06/2034	174	0,02
500.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/03/2026	501	0,07
800.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.88%, 30/03/2027	760	0,11
400.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 2.63%, 16/11/2027	387	0,05
500.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.25%, 29/03/2029	514	0,07
500.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.63%, 16/01/2030	451	0,06
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.25%, 18/11/2030	293	0,04
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.30%, 22/03/2033	293	0,04
400.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.13%, 16/11/2038	408	0,06
200.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.50%, 21/01/2041	140	0,02
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.50%, 17/06/2025 ¹	295	0,04
400.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 4.63%, 24/03/2026 ¹	398	0,06
700.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.88%, 14/06/2027 ¹	669	0,09

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 7.50%, 09/06/2028 ¹	326	0,05
300.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 4.63%, 27/06/2028 ¹	292	0,04
500.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.88%, 17/06/2029 ¹	463	0,06
400.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.50%, 20/03/2030 ¹	358	0,05
500.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 4.38%, 28/03/2031 ¹	459	0,06
200.000	EUR	Volkswagen International Finance NV, FRN, 7.88%, 09/06/2032 ¹	226	0,03
100.000	EUR	Wabtec Transportation Netherlands BV, 1.25%, 03/12/2027	92	0,01
200.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 0.84%, 25/09/2025	191	0,03
300.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.33%, 25/09/2028	267	0,04
200.000	EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.82%, 25/09/2031	169	0,02
100.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 3.00%, 23/09/2026	99	0,01
200.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 1.50%, 22/03/2027	190	0,03
100.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 3.25%, 18/03/2029	100	0,01
100.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 0.75%, 03/07/2030	86	0,01
300.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 3.75%, 03/04/2031	307	0,04
150.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 2.25%, 09/04/2026	145	0,02
200.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 2.13%, 15/04/2027	190	0,03
400.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 1.35%, 15/04/2028	361	0,05
200.000	EUR	WPC Eurobond BV, REIT, 0.95%, 01/06/2030	166	0,02
200.000	EUR	Wurth Finance International BV, 1.00%, 26/05/2025	194	0,03
75.000	EUR	Wurth Finance International BV, 0.75%, 22/11/2027	69	0,01
400.000	EUR	Wurth Finance International BV, 2.13%, 23/08/2030	375	0,05
Niederlande - Gesamt			113.732	15,88
Neuseeland (31. März 2023: 0,31 %)				
200.000	EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 1.13%, 20/03/2025	195	0,03
300.000	EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 3.53%, 24/01/2028	301	0,04
200.000	EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd., 0.38%, 17/09/2029	172	0,03
125.000	EUR	ASB Bank Ltd., 4.50%, 16/03/2027	128	0,02
100.000	EUR	ASB Bank Ltd., 0.25%, 08/09/2028	87	0,01
100.000	EUR	ASB Bank Ltd., 0.50%, 24/09/2029	86	0,01
100.000	EUR	Chorus Ltd., FRN, 0.88%, 05/12/2026	94	0,01
100.000	EUR	Chorus Ltd., FRN, 3.63%, 07/09/2029	100	0,02
150.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 1.10%, 24/03/2026	143	0,02
300.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.43%, 14/12/2026	277	0,04
350.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.10%, 13/07/2027	314	0,04
Neuseeland - Gesamt			1.897	0,27
Norwegen (31. März 2023: 0,62 %)				
200.000	EUR	Aker BP ASA, 1.13%, 12/05/2029	177	0,03
219.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 1.63%, 31/05/2026	214	0,03
400.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 3.63%, 16/02/2027	400	0,06
375.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 0.38%, 18/01/2028	345	0,05
400.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.50%, 19/07/2028	411	0,06
200.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 0.25%, 23/02/2029	176	0,02
175.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.00%, 14/03/2029	179	0,03
200.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.63%, 01/11/2029	208	0,03
350.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.63%, 28/02/2033	355	0,05
100.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 5.00%, 13/09/2033	103	0,01
300.000	EUR	Norsk Hydro ASA, 1.13%, 11/04/2025	292	0,04
100.000	EUR	Norsk Hydro ASA, 2.00%, 11/04/2029	93	0,01
300.000	EUR	Santander Consumer Bank A/S, 0.50%, 11/08/2025	287	0,04
100.000	EUR	Santander Consumer Bank A/S, 0.13%, 14/04/2026	93	0,01
100.000	EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 1.75%, 27/04/2027	95	0,01
100.000	EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 0.13%, 03/03/2028	88	0,01
100.000	EUR	SpareBank 1 SMN, 3.13%, 22/12/2025	99	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Norwegen (Fortsetzung)				
150.000	EUR	SpareBank 1 SMN, 0.13%, 11/09/2026	138	0,02
100.000	EUR	SpareBank 1 SMN, 0.01%, 18/02/2028	88	0,01
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 2.88%, 20/09/2025	99	0,02
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.25%, 09/11/2026	92	0,01
200.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 3.75%, 23/11/2027	202	0,03
200.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 4.88%, 24/08/2028	210	0,03
150.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 3.63%, 12/03/2029	152	0,02
100.000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, FRN, 0.38%, 15/07/2027	92	0,01
100.000	EUR	Storebrand Livsforsikring A/S, FRN, 1.88%, 30/09/2051	81	0,01
Norwegen - Gesamt			4.769	0,67
Polen (31. März 2023: 0,11 %)				
200.000	EUR	Bank Polska Kasa Opieki SA, FRN, 5.50%, 23/11/2027	204	0,03
250.000	EUR	Orlen SA, 1.13%, 27/05/2028	226	0,03
300.000	EUR	Orlen SA, 4.75%, 13/07/2030	308	0,04
Polen - Gesamt			738	0,10
Portugal (31. März 2023: 0,08 %)				
200.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 1.13%, 12/02/2027	190	0,03
400.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 1.75%, 07/04/2028	376	0,05
300.000	EUR	Brisa-Concessao Rodoviaria SA, 2.38%, 10/05/2027	290	0,04
100.000	EUR	Fidelidade - Cia de Seguros SA, FRN, 4.25%, 04/09/2031	95	0,01
200.000	EUR	Floene Energias SA, FRN, 4.88%, 03/07/2028	207	0,03
Portugal - Gesamt			1.158	0,16
Rumänien (31. März 2023: 0,00 %)				
100.000	EUR	Banca Comerciala Romana SA, FRN, 7.63%, 19/05/2027	105	0,01
Rumänien - Gesamt			105	0,01
Singapur (31. März 2023: 0,02 %)				
150.000	EUR	CapitaLand Ascendas REIT, 0.75%, 23/06/2028	129	0,02
Singapur - Gesamt			129	0,02
Slowakei (31. März 2023: 0,03 %)				
			-	-
Südkorea (31. März 2023: 0,02 %)				
			-	-
Spanien (31. März 2023: 4,91 %)				
300.000	EUR	Abanca Corp. Bancaria SA, FRN, 5.88%, 02/04/2030	322	0,04
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 0.63%, 15/07/2025	96	0,01
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.38%, 20/05/2026	192	0,03
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.00%, 27/02/2027	187	0,03
300.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.38%, 27/09/2027	288	0,04
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 4.13%, 31/01/2028	203	0,03
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.25%, 07/02/2028	92	0,01
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.13%, 26/03/2028	182	0,03
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.25%, 29/03/2029	188	0,03
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.63%, 15/07/2029	90	0,01
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 3.00%, 27/03/2031	190	0,03
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.88%, 26/03/2032	86	0,01
300.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, FRN, 4.13%, 07/08/2029	305	0,04
200.000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 0.38%, 07/10/2027	179	0,03
100.000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 3.75%, 25/04/2030	98	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Spanien (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 5.13%, 23/04/2031	210	0,03
300.000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1.38%, 26/01/2032	248	0,04
100.000	EUR	ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA, 1.88%, 20/04/2026	96	0,01
100.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 1.50%, 18/09/2026	96	0,01
100.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 2.88%, 20/05/2027	98	0,01
200.000	EUR	Amadeus IT Group SA, 1.88%, 24/09/2028	189	0,03
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.38%, 14/05/2025	195	0,03
100.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.75%, 04/06/2025	97	0,01
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.75%, 26/11/2025	194	0,03
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.00%, 21/06/2026	284	0,04
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.38%, 15/11/2026	277	0,04
400.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.50%, 14/01/2027	369	0,05
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.50%, 10/02/2027	199	0,03
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.38%, 20/09/2027	300	0,04
300.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.38%, 14/10/2029	315	0,04
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.50%, 26/03/2031	201	0,03
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.88%, 15/01/2034	204	0,03
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 4.13%, 10/05/2026	201	0,03
600.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 0.13%, 24/03/2027	560	0,08
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 0.88%, 14/01/2029	181	0,03
500.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 4.63%, 13/01/2031	522	0,07
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 5.75%, 15/09/2033	211	0,03
400.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, FRN, 4.88%, 08/02/2036	403	0,06
300.000	EUR	Banco de Sabadell SA, 0.88%, 22/07/2025	290	0,04
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.38%, 08/09/2026	204	0,03
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 1.13%, 11/03/2027	191	0,03
100.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 0.88%, 16/06/2028	91	0,01
400.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.13%, 10/11/2028	419	0,06
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.25%, 07/02/2029	208	0,03
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.00%, 07/06/2029	210	0,03
400.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.50%, 08/09/2029	422	0,06
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 4.00%, 15/01/2030	203	0,03
300.000	EUR	Banco Santander SA, 1.38%, 05/01/2026	289	0,04
400.000	EUR	Banco Santander SA, 3.75%, 16/01/2026	402	0,06
500.000	EUR	Banco Santander SA, 3.25%, 04/04/2026	493	0,07
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.30%, 04/10/2026	278	0,04
400.000	EUR	Banco Santander SA, 3.13%, 19/01/2027	394	0,06
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.50%, 04/02/2027	276	0,04
300.000	EUR	Banco Santander SA, 1.13%, 23/06/2027	280	0,04
300.000	EUR	Banco Santander SA, 3.88%, 16/01/2028	304	0,04
300.000	EUR	Banco Santander SA, 2.13%, 08/02/2028	283	0,04
500.000	EUR	Banco Santander SA, 0.20%, 11/02/2028	442	0,06
300.000	EUR	Banco Santander SA, 4.25%, 12/06/2030	313	0,04
100.000	EUR	Banco Santander SA, 1.63%, 22/10/2030	86	0,01
700.000	EUR	Banco Santander SA, 4.88%, 18/10/2031	746	0,10
200.000	EUR	Banco Santander SA, 1.00%, 04/11/2031	171	0,02
500.000	EUR	Banco Santander SA, 3.75%, 09/01/2034	505	0,07
300.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 3.63%, 27/09/2026	299	0,04
200.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 0.50%, 24/03/2027	188	0,02
200.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 4.63%, 18/10/2027	203	0,03
200.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 3.50%, 09/01/2028	199	0,03
200.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 0.63%, 24/06/2029	178	0,02
400.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 3.50%, 09/01/2030	398	0,06
500.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 5.75%, 23/08/2033	525	0,07
300.000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 5.00%, 22/04/2034	306	0,04
200.000	EUR	Bankinter SA, 0.88%, 08/07/2026	188	0,03
500.000	EUR	Bankinter SA, 0.63%, 06/10/2027	453	0,06
100.000	EUR	Bankinter SA, FRN, 4.38%, 03/05/2030	104	0,01
200.000	EUR	Bankinter SA, FRN, 4.88%, 13/09/2031	210	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Spanien (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Bankinter SA, FRN, 1.25%, 23/12/2032	90	0,01
200.000	EUR	CaixaBank SA, 0.38%, 03/02/2025	194	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 27/03/2026	191	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.38%, 19/06/2026	190	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, 0.75%, 09/07/2026	188	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 12/11/2026	187	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, 3.75%, 07/09/2029	204	0,03
300.000	EUR	CaixaBank SA, 4.25%, 06/09/2030	312	0,04
400.000	EUR	CaixaBank SA, 4.38%, 29/11/2033	423	0,06
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 1.63%, 13/04/2026	196	0,03
100.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.75%, 10/07/2026	96	0,01
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.38%, 18/11/2026	189	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 4.63%, 16/05/2027	203	0,03
400.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.63%, 21/01/2028	371	0,05
500.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.75%, 26/05/2028	458	0,06
400.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.50%, 09/02/2029	355	0,05
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 5.00%, 19/07/2029	209	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 2.25%, 17/04/2030	195	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 5.38%, 14/11/2030	216	0,03
500.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 1.25%, 18/06/2031	468	0,07
500.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 4.13%, 09/02/2032	508	0,07
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 6.25%, 23/02/2033	212	0,03
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 6.13%, 30/05/2034	213	0,03
300.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 2.25%, 12/04/2026	291	0,04
100.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 0.75%, 15/11/2026	93	0,01
300.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 1.00%, 15/09/2027	275	0,04
300.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 1.50%, 08/06/2028	276	0,04
200.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 1.25%, 15/01/2029	180	0,03
200.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 2.00%, 15/09/2032	175	0,03
300.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 2.00%, 15/02/2033	260	0,04
100.000	EUR	Cellnex Telecom SA, 1.00%, 20/04/2027	92	0,01
200.000	EUR	Cellnex Telecom SA, 1.88%, 26/06/2029	183	0,03
300.000	EUR	Cellnex Telecom SA, 1.75%, 23/10/2030	267	0,04
100.000	EUR	Criteria Caixa SA, 0.88%, 28/10/2027	91	0,01
300.000	EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.13%, 04/04/2029	309	0,04
350.000	EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 3.50%, 16/07/2030	350	0,05
350.000	EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.38%, 04/04/2032	368	0,05
200.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.25%, 06/02/2025	196	0,03
400.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.75%, 27/10/2026	375	0,05
100.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.38%, 05/05/2028	94	0,01
200.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.38%, 05/11/2032	156	0,02
100.000	EUR	Enagas Financiaciones SA, 3.63%, 24/01/2034	99	0,01
250.000	EUR	FCC Aqualia SA, 2.63%, 08/06/2027	243	0,03
100.000	EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 1.66%, 04/12/2026	95	0,01
200.000	EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 5.25%, 30/10/2029	213	0,03
100.000	EUR	Ferrovial Emisiones SA, 1.38%, 31/03/2025	98	0,01
400.000	EUR	Ferrovial Emisiones SA, 1.38%, 14/05/2026	384	0,05
200.000	EUR	Ferrovial Emisiones SA, 0.54%, 12/11/2028	177	0,03
200.000	EUR	Ibercaja Banco SA, FRN, 5.63%, 07/06/2027	207	0,03
300.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.00%, 07/03/2025	293	0,04
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 0.88%, 16/06/2025	194	0,03
100.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.25%, 28/10/2026	95	0,01
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.25%, 13/09/2027	188	0,03
100.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.13%, 22/11/2028	100	0,01
100.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.62%, 29/11/2029	93	0,01
400.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.38%, 11/03/2032	350	0,05
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.38%, 22/11/2032	200	0,03
300.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.63%, 13/07/2033	305	0,04
200.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, FRN, 1.58%, 16/08/2027 ¹	180	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Spanien (Fortsetzung)				
300.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, FRN, 4.88%, 25/04/2028 ¹	304	0,04
300.000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, FRN, 4.87%, 16/01/2031 ¹	303	0,04
100.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, 1.35%, 14/10/2028	92	0,01
400.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, 0.75%, 22/06/2029	346	0,05
300.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, FRN, 1.63%, 28/11/2025	290	0,04
100.000	EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, REIT, FRN, 2.00%, 17/04/2026	97	0,01
100.000	EUR	Lar Espana Real Estate Socimi SA, REIT, 1.75%, 22/07/2026	93	0,01
100.000	EUR	Mapfre SA, 1.63%, 19/05/2026	97	0,01
100.000	EUR	Mapfre SA, 2.88%, 13/04/2030	93	0,01
200.000	EUR	Mapfre SA, FRN, 4.38%, 31/03/2047	200	0,03
100.000	EUR	Mapfre SA, FRN, 4.13%, 07/09/2048	98	0,01
200.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.75%, 26/05/2025	195	0,03
150.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.88%, 02/11/2026	144	0,02
200.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 2.38%, 13/07/2027	192	0,03
400.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 2.38%, 18/09/2029	372	0,05
100.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.38%, 01/06/2030	86	0,01
100.000	EUR	Merlin Properties Socimi SA, REIT, 1.88%, 04/12/2034	80	0,01
100.000	EUR	Prosegur Cash SA, 1.38%, 04/02/2026	96	0,01
100.000	EUR	Prosegur Cia de Seguridad SA, 2.50%, 06/04/2029	96	0,01
400.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.00%, 21/04/2026	383	0,05
100.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.25%, 13/03/2027	95	0,01
200.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.38%, 24/07/2028	179	0,03
100.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.50%, 24/05/2033	80	0,01
300.000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 3.00%, 17/01/2034	296	0,04
100.000	EUR	Redeia Corp. SA, 0.88%, 14/04/2025	97	0,01
400.000	EUR	Redeia Corp. SA, FRN, 4.63%, 05/07/2028 ¹	408	0,06
100.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.00%, 23/02/2026	93	0,01
100.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.50%, 14/11/2026	92	0,01
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.50%, 14/01/2027	184	0,03
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 4.13%, 05/05/2028	205	0,03
500.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 3.75%, 17/01/2029	504	0,07
600.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.50%, 11/09/2025	582	0,08
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.46%, 13/04/2026	192	0,03
300.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.45%, 22/01/2027	285	0,04
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.20%, 21/08/2027	186	0,03
300.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.72%, 12/01/2028	283	0,04
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.32%, 17/10/2028	96	0,01
400.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.79%, 12/03/2029	374	0,05
600.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.93%, 17/10/2029	587	0,08
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 0.66%, 03/02/2030	86	0,01
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.59%, 25/05/2031	190	0,03
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.93%, 17/10/2031	181	0,03
400.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 3.70%, 24/01/2032	404	0,06
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.81%, 21/05/2032	88	0,01
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 4.18%, 21/11/2033	208	0,03
200.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 4.06%, 24/01/2036	204	0,03
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.96%, 01/07/2039	78	0,01
100.000	EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.86%, 13/07/2040	76	0,01
200.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 1.00%, 01/12/2026	191	0,03
100.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 5.13%, 21/02/2029	104	0,01
Spanien - Gesamt			42.797	5,97
Schweden (31. März 2023: 2,38 %)				
100.000	EUR	Akelius Residential Property AB, REIT, FRN, 1.75%, 07/02/2025	98	0,01
100.000	EUR	Alfa Laval Treasury International AB, 1.38%, 18/02/2029	91	0,01
200.000	EUR	Assa Abloy AB, 3.75%, 13/09/2026	202	0,03
150.000	EUR	Assa Abloy AB, 3.88%, 13/09/2030	155	0,02
200.000	EUR	Assa Abloy AB, 4.13%, 13/09/2035	213	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Schweden (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Atlas Copco AB, 0.63%, 30/08/2026	188	0,03
250.000	EUR	Castellum AB, REIT, 0.75%, 04/09/2026	230	0,03
100.000	EUR	Electrolux AB, 4.13%, 05/10/2026	101	0,01
200.000	EUR	Electrolux AB, 4.50%, 29/09/2028	204	0,03
100.000	EUR	Electrolux AB, 2.50%, 18/05/2030	92	0,01
150.000	EUR	Ellevio AB, 4.13%, 07/03/2034	154	0,02
150.000	EUR	Epiroc AB, 3.63%, 28/02/2031	151	0,02
200.000	EUR	EQT AB, FRN, 2.38%, 06/04/2028	189	0,03
100.000	EUR	EQT AB, FRN, 0.88%, 14/05/2031	81	0,01
250.000	EUR	EQT AB, FRN, 2.88%, 06/04/2032	229	0,03
100.000	EUR	Essity AB, 1.13%, 05/03/2025	97	0,01
100.000	EUR	Essity AB, 1.63%, 30/03/2027	96	0,01
100.000	EUR	Essity AB, 0.25%, 08/02/2031	90	0,01
100.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.88%, 14/03/2025	98	0,01
100.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.88%, 23/01/2026	95	0,01
300.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.13%, 29/01/2027	269	0,04
100.000	EUR	Fastighets AB Balder, REIT, 1.25%, 28/01/2028	86	0,01
200.000	EUR	Heimstaden Bostad AB, REIT, FRN, 1.13%, 21/01/2026	180	0,03
125.000	EUR	Investor AB, 1.50%, 12/09/2030	112	0,02
150.000	EUR	Investor AB, 2.75%, 10/06/2032	145	0,02
100.000	EUR	Investor AB, 0.38%, 29/10/2035	72	0,01
100.000	EUR	Investor AB, 1.50%, 20/06/2039	77	0,01
500.000	EUR	Lansforsakringar Bank AB, 3.75%, 17/01/2029	503	0,07
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 1.88%, 28/02/2025	98	0,01
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 4.25%, 08/09/2028	102	0,02
125.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 0.88%, 05/09/2029	108	0,02
100.000	EUR	Molnlycke Holding AB, 0.63%, 15/01/2031	81	0,01
275.000	EUR	Sagax AB, REIT, FRN, 2.25%, 13/03/2025	269	0,04
250.000	EUR	Sagax AB, REIT, FRN, 1.13%, 30/01/2027	230	0,03
100.000	EUR	Sandvik AB, 3.00%, 18/06/2026	99	0,01
100.000	EUR	Sandvik AB, 2.13%, 07/06/2027	96	0,01
100.000	EUR	Sandvik AB, 0.38%, 25/11/2028	88	0,01
300.000	EUR	Sandvik AB, 3.75%, 27/09/2029	305	0,04
400.000	EUR	Scania CV AB, 2.25%, 03/06/2025	392	0,06
100.000	EUR	Securitas AB, 1.25%, 06/03/2025	97	0,01
100.000	EUR	Securitas AB, 0.25%, 22/02/2028	89	0,01
300.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.25%, 24/11/2025	298	0,04
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.00%, 09/11/2026	202	0,03
275.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.75%, 11/11/2026	264	0,04
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.38%, 11/02/2027	183	0,03
400.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.13%, 29/06/2027	409	0,06
350.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.75%, 09/08/2027	320	0,05
400.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.75%, 07/02/2028	403	0,06
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.88%, 09/05/2028	203	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.38%, 21/06/2028	175	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.38%, 06/11/2028	206	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.63%, 12/11/2029	172	0,02
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 0.75%, 03/11/2031	183	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 5.00%, 17/08/2033	206	0,03
200.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 4.50%, 27/11/2034	202	0,03
200.000	EUR	SKF AB, 1.25%, 17/09/2025	193	0,03
100.000	EUR	SKF AB, 3.13%, 14/09/2028	99	0,01
150.000	EUR	SKF AB, 0.25%, 15/02/2031	120	0,02
400.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.00%, 15/04/2025	389	0,06
400.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 05/05/2026	403	0,06
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.05%, 03/09/2026	92	0,01
425.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.13%, 03/11/2026	391	0,06
300.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.88%, 10/05/2027	305	0,04
150.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 01/11/2027	152	0,02

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Schweden (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.01%, 02/12/2027	89	0,01
400.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.38%, 17/02/2028	402	0,06
175.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.05%, 06/09/2028	153	0,02
300.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.38%, 23/02/2029	273	0,04
200.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 2.63%, 05/09/2029	195	0,03
175.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.50%, 18/02/2030	149	0,02
175.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 15/02/2034	177	0,03
100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.25%, 01/06/2033	96	0,01
250.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 5.00%, 16/08/2034	260	0,04
100.000	EUR	Swedbank AB, 0.75%, 05/05/2025	97	0,01
200.000	EUR	Swedbank AB, 3.75%, 14/11/2025	200	0,03
550.000	EUR	Swedbank AB, 0.25%, 02/11/2026	509	0,07
300.000	EUR	Swedbank AB, 1.30%, 17/02/2027	281	0,04
175.000	EUR	Swedbank AB, 2.10%, 25/05/2027	169	0,02
150.000	EUR	Swedbank AB, 0.20%, 12/01/2028	132	0,02
300.000	EUR	Swedbank AB, 4.25%, 11/07/2028	307	0,04
200.000	EUR	Swedbank AB, 4.13%, 13/11/2028	207	0,03
100.000	EUR	Swedbank AB, 4.38%, 05/09/2030	104	0,02
400.000	EUR	Swedbank AB, FRN, 0.30%, 20/05/2027	372	0,05
350.000	EUR	Swedbank AB, FRN, 3.63%, 23/08/2032	342	0,05
200.000	EUR	Tele2 AB, 2.13%, 15/05/2028	190	0,03
100.000	EUR	Tele2 AB, 3.75%, 22/11/2029	101	0,02
100.000	EUR	Tele2 AB, 0.75%, 23/03/2031	85	0,01
150.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.13%, 08/02/2027	139	0,02
100.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 5.38%, 29/05/2028	105	0,02
350.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.00%, 26/05/2029	297	0,04
100.000	EUR	Telia Co. AB, 3.88%, 01/10/2025	101	0,01
100.000	EUR	Telia Co. AB, 3.00%, 07/09/2027	100	0,01
100.000	EUR	Telia Co. AB, 0.13%, 27/11/2030	82	0,01
300.000	EUR	Telia Co. AB, 3.63%, 22/02/2032	307	0,04
400.000	EUR	Telia Co. AB, 2.13%, 20/02/2034	362	0,05
250.000	EUR	Telia Co. AB, 1.63%, 23/02/2035	212	0,03
100.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 1.38%, 11/05/2081	94	0,01
100.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 4.63%, 21/12/2082	101	0,01
100.000	EUR	Telia Co. AB, FRN, 2.75%, 30/06/2083	94	0,01
125.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.63%, 14/02/2025	122	0,02
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 1.63%, 26/05/2025	98	0,01
200.000	EUR	Volvo Treasury AB, 3.50%, 17/11/2025	200	0,03
150.000	EUR	Volvo Treasury AB, 2.63%, 20/02/2026	147	0,02
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.00%, 18/05/2026	93	0,01
300.000	EUR	Volvo Treasury AB, 3.88%, 29/08/2026	303	0,04
300.000	EUR	Volvo Treasury AB, 3.13%, 08/09/2026	297	0,04
300.000	EUR	Volvo Treasury AB, 3.63%, 25/05/2027	302	0,04
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 2.00%, 19/08/2027	96	0,01
Schweden - Gesamt			20.464	2,86
Schweiz (31. März 2023: 0,78 %)				
300.000	EUR	Credit Suisse AG, 0.25%, 05/01/2026	283	0,04
300.000	EUR	Credit Suisse AG, 1.50%, 10/04/2026	288	0,04
300.000	EUR	Credit Suisse AG, 5.50%, 20/08/2026	313	0,04
300.000	EUR	Credit Suisse AG, 0.25%, 01/09/2028	261	0,04
100.000	EUR	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 5.23%, 01/11/2027	105	0,01
200.000	EUR	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 4.84%, 03/11/2028	207	0,03
500.000	EUR	UBS AG, 0.01%, 31/03/2026	467	0,07
300.000	EUR	UBS AG, 0.01%, 29/06/2026	279	0,04
200.000	EUR	UBS AG, 0.50%, 31/03/2031	164	0,02
500.000	EUR	UBS Group AG, 1.25%, 01/09/2026	474	0,07
200.000	EUR	UBS Group AG, 0.25%, 24/02/2028	177	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Schweiz (Fortsetzung)				
200.000	EUR	UBS Group AG, 0.65%, 10/09/2029	171	0,02
400.000	EUR	UBS Group AG, 0.88%, 03/11/2031	326	0,05
300.000	EUR	UBS Group AG, 0.63%, 18/01/2033	229	0,03
400.000	EUR	UBS Group AG, 0.63%, 24/02/2033	306	0,04
250.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 29/01/2026	242	0,03
600.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 2.13%, 13/10/2026	584	0,08
600.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 03/11/2026	567	0,08
400.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 2.75%, 15/06/2027	391	0,05
300.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 1.00%, 24/06/2027	282	0,04
275.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.65%, 14/01/2028	253	0,04
500.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 4.63%, 17/03/2028	513	0,07
450.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 05/11/2028	398	0,05
800.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 7.75%, 01/03/2029	913	0,13
500.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 3.13%, 15/06/2030	487	0,07
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 4.38%, 11/01/2031	206	0,03
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 4.75%, 17/03/2032	211	0,03
500.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 2.88%, 02/04/2032	469	0,07
200.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 4.13%, 09/06/2033	203	0,03
		Schweiz - Gesamt	9.769	1,37
Vereinigtes Königreich (31. März 2023: 6,55 %)				
200.000	EUR	3i Group plc, 4.88%, 14/06/2029	209	0,03
100.000	EUR	Anglo American Capital plc, 1.63%, 18/09/2025	97	0,01
100.000	EUR	Anglo American Capital plc, 1.63%, 11/03/2026	96	0,01
300.000	EUR	Anglo American Capital plc, 4.50%, 15/09/2028	310	0,04
300.000	EUR	Anglo American Capital plc, 5.00%, 15/03/2031	319	0,05
100.000	EUR	Anglo American Capital plc, 4.13%, 15/03/2032	100	0,01
200.000	EUR	Anglo American Capital plc, FRN, 4.75%, 21/09/2032	210	0,03
150.000	EUR	Aon Global Ltd., 2.88%, 14/05/2026	147	0,02
450.000	EUR	AstraZeneca plc, 3.63%, 03/03/2027	457	0,06
200.000	EUR	AstraZeneca plc, 1.25%, 12/05/2028	186	0,03
100.000	EUR	AstraZeneca plc, 0.38%, 03/06/2029	88	0,01
325.000	EUR	AstraZeneca plc, 3.75%, 03/03/2032	339	0,05
150.000	EUR	Aviva plc, 1.88%, 13/11/2027	145	0,02
200.000	EUR	Aviva plc, FRN, 3.38%, 04/12/2045	196	0,03
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.38%, 24/01/2026	294	0,04
100.000	EUR	Barclays plc, FRN, 2.89%, 31/01/2027	98	0,01
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.88%, 28/01/2028	277	0,04
400.000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.58%, 09/08/2029	348	0,05
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 4.92%, 08/08/2030	314	0,04
300.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.13%, 22/03/2031	279	0,04
500.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.11%, 12/05/2032	412	0,06
400.000	EUR	Barclays plc, FRN, 4.51%, 31/01/2033	410	0,06
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 5.26%, 29/01/2034	216	0,03
200.000	EUR	BG Energy Capital plc, 2.25%, 21/11/2029	189	0,03
50.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.95%, 03/03/2025	49	0,01
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.97%, 27/02/2026	199	0,03
350.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.21%, 25/09/2026	342	0,05
70.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.57%, 16/02/2027	67	0,01
150.000	EUR	BP Capital Markets plc, 0.83%, 08/11/2027	138	0,02
400.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.52%, 07/04/2028	389	0,06
100.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.59%, 03/07/2028	93	0,01
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.64%, 26/06/2029	184	0,03
250.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.23%, 08/05/2031	216	0,03
200.000	EUR	BP Capital Markets plc, 2.82%, 07/04/2032	191	0,03
225.000	EUR	BP Capital Markets plc, 1.10%, 15/11/2034	177	0,03
700.000	EUR	BP Capital Markets plc, FRN, 3.25%, 22/03/2026 ¹	682	0,10
650.000	EUR	BP Capital Markets plc, FRN, 3.63%, 22/03/2029 ¹	620	0,09

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)				
100.000	EUR	Brambles Finance plc, 1.50%, 04/10/2027	94	0,01
125.000	EUR	Brambles Finance plc, 4.25%, 22/03/2031	131	0,02
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 0.50%, 12/09/2025	96	0,01
500.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.75%, 10/03/2026	483	0,07
600.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.50%, 23/06/2027	565	0,08
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 2.75%, 30/08/2027	98	0,01
150.000	EUR	British Telecommunications plc, 2.13%, 26/09/2028	142	0,02
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.13%, 12/09/2029	89	0,01
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 3.75%, 13/05/2031	101	0,02
100.000	EUR	British Telecommunications plc, 3.38%, 30/08/2032	99	0,01
375.000	EUR	British Telecommunications plc, FRN, 4.25%, 06/01/2033	391	0,05
150.000	EUR	BUPA Finance plc, 5.00%, 12/10/2030	159	0,02
150.000	EUR	Cadent Finance plc, 4.25%, 05/07/2029	155	0,02
300.000	EUR	Cadent Finance plc, 0.63%, 19/03/2030	253	0,04
100.000	EUR	Cadent Finance plc, 0.75%, 11/03/2032	81	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 2.38%, 07/05/2025	99	0,01
400.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 27/03/2026	387	0,05
250.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.50%, 08/11/2027	235	0,03
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 26/05/2028	94	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 0.20%, 02/12/2028	87	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.13%, 12/04/2029	90	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.88%, 18/03/2030	92	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 0.70%, 12/09/2031	83	0,01
300.000	EUR	Compass Group plc, 3.25%, 06/02/2031	300	0,04
100.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.00%, 22/04/2025	97	0,01
300.000	EUR	Diageo Finance plc, 3.50%, 26/06/2025	299	0,04
200.000	EUR	Diageo Finance plc, 2.38%, 20/05/2026	196	0,03
300.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.88%, 27/03/2027	289	0,04
350.000	EUR	Diageo Finance plc, 1.50%, 22/10/2027	331	0,05
200.000	EUR	Diageo Finance plc, 2.50%, 27/03/2032	191	0,03
325.000	EUR	DS Smith plc, 4.50%, 27/07/2030	340	0,05
150.000	EUR	DS Smith plc, FRN, 0.88%, 12/09/2026	141	0,02
350.000	EUR	DS Smith plc, FRN, 4.38%, 27/07/2027	357	0,05
125.000	EUR	easyJet plc, 3.75%, 20/03/2031	124	0,02
250.000	EUR	Experian Finance plc, 1.38%, 25/06/2026	239	0,03
250.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 4.00%, 16/06/2025	251	0,04
250.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.25%, 21/05/2026	239	0,03
100.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.00%, 12/09/2026	95	0,01
200.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.38%, 12/09/2029	183	0,03
150.000	EUR	GlaxoSmithKline Capital plc, 1.75%, 21/05/2030	138	0,02
400.000	EUR	HSBC Holdings plc, 3.00%, 30/06/2025	395	0,06
500.000	EUR	HSBC Holdings plc, 2.50%, 15/03/2027	487	0,07
200.000	EUR	HSBC Holdings plc, 3.13%, 07/06/2028	195	0,03
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.31%, 13/11/2026	237	0,03
700.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 3.02%, 15/06/2027	689	0,10
375.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 4.75%, 10/03/2028	386	0,05
250.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.64%, 24/09/2029	220	0,03
225.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 0.77%, 13/11/2031	189	0,03
275.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 4.79%, 10/03/2032	290	0,04
450.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 6.36%, 16/11/2032	481	0,07
475.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 4.86%, 23/05/2033	506	0,07
350.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 4.60%, 22/03/2035	354	0,05
125.000	EUR	Informa plc, FRN, 2.13%, 06/10/2025	122	0,02
100.000	EUR	Informa plc, FRN, 1.25%, 22/04/2028	91	0,01
350.000	EUR	InterContinental Hotels Group plc, FRN, 2.13%, 15/05/2027	336	0,05
100.000	EUR	Intermediate Capital Group plc, 1.63%, 17/02/2027	93	0,01
150.000	EUR	Intermediate Capital Group plc, FRN, 2.50%, 28/01/2030	136	0,02
100.000	EUR	International Distributions Services plc, 1.25%, 08/10/2026	94	0,01
200.000	EUR	International Distributions Services plc, FRN, 5.25%, 14/09/2028	208	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Investec Bank plc, FRN, 1.25%, 11/08/2026	192	0,03
100.000	EUR	ITV plc, FRN, 1.38%, 26/09/2026	95	0,01
100.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.38%, 28/01/2025	97	0,01
200.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.38%, 09/04/2026	196	0,03
250.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 4.13%, 30/05/2027	255	0,04
200.000	EUR	Lloyds Bank plc, 1.25%, 13/01/2025	196	0,03
300.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, 1.50%, 12/09/2027	282	0,04
300.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.50%, 01/04/2026	299	0,04
175.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 4.50%, 11/01/2029	181	0,03
200.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.13%, 24/08/2030	195	0,03
250.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 4.75%, 21/09/2031	263	0,04
200.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 4.38%, 05/04/2034	199	0,03
100.000	EUR	London Stock Exchange Group plc, 1.75%, 06/12/2027	95	0,01
125.000	EUR	London Stock Exchange Group plc, 1.75%, 19/09/2029	115	0,02
300.000	EUR	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.25%, 03/02/2025	291	0,04
100.000	EUR	Mobico Group plc, 4.88%, 26/09/2031	99	0,01
200.000	EUR	Mondi Finance plc, 1.63%, 27/04/2026	192	0,03
425.000	EUR	Motability Operations Group plc, 0.88%, 14/03/2025	414	0,06
150.000	EUR	Motability Operations Group plc, 0.38%, 03/01/2026	142	0,02
100.000	EUR	Motability Operations Group plc, 3.63%, 24/07/2029	101	0,01
100.000	EUR	Motability Operations Group plc, 3.50%, 17/07/2031	100	0,01
400.000	EUR	Motability Operations Group plc, 3.88%, 24/01/2034	410	0,06
100.000	EUR	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc, 3.53%, 20/09/2028	100	0,01
100.000	EUR	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc, 3.95%, 20/09/2032	102	0,02
100.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.19%, 20/01/2025	97	0,01
150.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.82%, 07/07/2032	121	0,02
100.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.87%, 26/11/2040	68	0,01
200.000	EUR	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	194	0,03
100.000	EUR	National Grid plc, 0.16%, 20/01/2028	88	0,01
200.000	EUR	National Grid plc, 0.25%, 01/09/2028	174	0,03
300.000	EUR	National Grid plc, 3.88%, 16/01/2029	305	0,04
125.000	EUR	National Grid plc, 0.55%, 18/09/2029	107	0,02
100.000	EUR	National Grid plc, 2.95%, 30/03/2030	97	0,01
400.000	EUR	National Grid plc, 0.75%, 01/09/2033	307	0,04
250.000	EUR	National Grid plc, 3.25%, 30/03/2034	237	0,03
250.000	EUR	National Grid plc, 4.28%, 16/01/2035	258	0,04
175.000	EUR	Nationwide Building Society, 0.25%, 22/07/2025	168	0,02
600.000	EUR	Nationwide Building Society, 4.50%, 01/11/2026	615	0,09
375.000	EUR	Nationwide Building Society, 2.00%, 28/04/2027	360	0,05
250.000	EUR	Nationwide Building Society, 0.25%, 14/09/2028	219	0,03
100.000	EUR	Nationwide Building Society, 3.25%, 05/09/2029	100	0,01
500.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 4.07%, 06/09/2028	508	0,07
350.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 4.77%, 16/02/2029	363	0,05
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 0.67%, 14/09/2029	176	0,02
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 0.78%, 26/02/2030	174	0,02
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 1.04%, 14/09/2032	179	0,03
200.000	EUR	NatWest Group plc, FRN, 5.76%, 28/02/2034	211	0,03
200.000	EUR	NatWest Markets plc, 2.75%, 02/04/2025	198	0,03
400.000	EUR	NatWest Markets plc, 0.13%, 12/11/2025	378	0,05
300.000	EUR	NatWest Markets plc, 0.13%, 18/06/2026	279	0,04
500.000	EUR	NatWest Markets plc, 1.38%, 02/03/2027	472	0,07
300.000	EUR	NatWest Markets plc, 4.25%, 13/01/2028	309	0,04
125.000	EUR	NatWest Markets plc, 3.63%, 09/01/2029	126	0,02
350.000	EUR	Omnicom Finance Holdings plc, 0.80%, 08/07/2027	323	0,05
100.000	EUR	Omnicom Finance Holdings plc, 1.40%, 08/07/2031	88	0,01
125.000	EUR	Omnicom Finance Holdings plc, 3.70%, 06/03/2032	126	0,02
300.000	EUR	OTE plc, 0.88%, 24/09/2026	281	0,04
100.000	EUR	Pearson Funding plc, 1.38%, 06/05/2025	97	0,01
100.000	EUR	Phoenix Group Holdings plc, 4.38%, 24/01/2029	99	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 3.63%, 14/09/2028	201	0,03
300.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 3.88%, 14/09/2033	305	0,04
400.000	EUR	Rentokil Initial plc, FRN, 0.88%, 30/05/2026	380	0,05
100.000	EUR	Rentokil Initial plc, FRN, 0.50%, 14/10/2028	88	0,01
300.000	EUR	Sage Group plc (The), 3.82%, 15/02/2028	305	0,04
200.000	EUR	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 3.53%, 25/08/2028	199	0,03
225.000	EUR	Santander UK Group Holdings plc, FRN, 0.60%, 13/09/2029	197	0,03
300.000	EUR	Severn Trent Utilities Finance plc, 4.00%, 05/03/2034	304	0,04
200.000	EUR	Sky Ltd., 2.50%, 15/09/2026	196	0,03
200.000	EUR	Smith & Nephew plc, 4.57%, 11/10/2029	211	0,03
200.000	EUR	Smiths Group plc, 2.00%, 23/02/2027	192	0,03
125.000	EUR	SSE plc, 1.25%, 16/04/2025	122	0,02
150.000	EUR	SSE plc, 0.88%, 06/09/2025	144	0,02
200.000	EUR	SSE plc, 1.38%, 04/09/2027	187	0,03
300.000	EUR	SSE plc, 2.88%, 01/08/2029	294	0,04
250.000	EUR	SSE plc, 1.75%, 16/04/2030	228	0,03
200.000	EUR	SSE plc, 4.00%, 05/09/2031	207	0,03
100.000	EUR	SSE plc, FRN, 3.13%, 14/04/2027 ¹	95	0,01
300.000	EUR	SSE plc, FRN, 4.00%, 21/01/2028 ¹	293	0,04
100.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.90%, 02/07/2027	94	0,01
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.85%, 27/01/2028	185	0,03
100.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 0.80%, 17/11/2029	88	0,01
400.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 2.50%, 09/09/2030	389	0,05
200.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 4.87%, 10/05/2031	211	0,03
400.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 1.20%, 23/09/2031	365	0,05
300.000	EUR	Standard Chartered plc, FRN, 4.20%, 04/03/2032	303	0,04
100.000	EUR	Swiss Re Finance UK plc, FRN, 2.71%, 04/06/2052	89	0,01
200.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, 0.88%, 29/05/2026	189	0,03
200.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, 4.25%, 27/02/2031	207	0,03
150.000	EUR	Tesco Corporate Treasury Services plc, FRN, 0.38%, 27/07/2029	129	0,02
100.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 4.00%, 18/04/2027	94	0,01
200.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 0.88%, 31/01/2028	168	0,02
150.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 4.38%, 18/01/2031	139	0,02
200.000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 1.25%, 31/01/2032	150	0,02
100.000	EUR	Unilever plc, 1.50%, 11/06/2039	80	0,01
200.000	EUR	United Utilities Water Finance plc, 3.75%, 23/05/2034	201	0,03
100.000	EUR	Virgin Money UK plc, FRN, 4.63%, 29/10/2028	103	0,01
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.88%, 11/09/2025	196	0,03
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.13%, 20/11/2025	193	0,03
600.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.20%, 25/08/2026	585	0,08
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 0.90%, 24/11/2026	94	0,01
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.50%, 24/07/2027	95	0,01
150.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.88%, 20/11/2029	139	0,02
250.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.63%, 24/11/2030	224	0,03
500.000	EUR	Vodafone Group plc, 1.60%, 29/07/2031	444	0,06
200.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.88%, 20/11/2037	184	0,03
100.000	EUR	Vodafone Group plc, 2.50%, 24/05/2039	87	0,01
100.000	EUR	Wellcome Trust Ltd. (The), 1.13%, 21/01/2027	95	0,01
100.000	EUR	WPP Finance 2013, 4.00%, 12/09/2033	101	0,01
100.000	EUR	WPP Finance 2016, 1.38%, 20/03/2025	98	0,01
150.000	EUR	Yorkshire Building Society, 0.63%, 21/09/2025	144	0,02
100.000	EUR	Yorkshire Building Society, 0.50%, 01/07/2028	89	0,01
Vereinigtes Königreich - Gesamt			45.119	6,30
Vereinigte Staaten (31. März 2023: 15,17 %)				
450.000	EUR	3M Co., 1.50%, 09/11/2026	428	0,06
100.000	EUR	3M Co., 1.75%, 15/05/2030	90	0,01
100.000	EUR	3M Co., 1.50%, 02/06/2031	87	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
200.000	EUR	AbbVie, Inc., 0.75%, 18/11/2027	184	0,03
100.000	EUR	AbbVie, Inc., 2.63%, 15/11/2028	98	0,01
200.000	EUR	AbbVie, Inc., 2.13%, 17/11/2028	191	0,01
100.000	EUR	AbbVie, Inc., 2.13%, 01/06/2029	95	0,01
100.000	EUR	AbbVie, Inc., 1.25%, 18/11/2031	87	0,01
200.000	EUR	Air Lease Corp., 3.70%, 15/04/2030	200	0,03
200.000	EUR	Air Products and Chemicals, Inc., 0.50%, 05/05/2028	179	0,03
100.000	EUR	Air Products and Chemicals, Inc., 0.80%, 05/05/2032	83	0,01
250.000	EUR	Air Products and Chemicals, Inc., 4.00%, 03/03/2035	262	0,04
100.000	EUR	American Honda Finance Corp., 3.50%, 24/04/2026	100	0,01
200.000	EUR	American Honda Finance Corp., 3.75%, 25/10/2027	203	0,03
250.000	EUR	American Honda Finance Corp., 0.30%, 07/07/2028	221	0,03
300.000	EUR	American International Group, Inc., 1.88%, 21/06/2027	284	0,04
100.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.38%, 04/04/2025	98	0,01
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.95%, 22/05/2026	192	0,03
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.45%, 15/01/2027	183	0,03
300.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.40%, 15/02/2027	274	0,04
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 4.13%, 16/05/2027	203	0,03
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.50%, 15/01/2028	178	0,03
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.88%, 21/05/2029	174	0,02
300.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.95%, 05/10/2030	254	0,04
200.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 4.63%, 16/05/2031	210	0,03
100.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.00%, 15/01/2032	82	0,01
150.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.25%, 21/05/2033	121	0,02
200.000	EUR	Amgen, Inc., 2.00%, 25/02/2026	195	0,03
200.000	EUR	Apple, Inc., 0.88%, 24/05/2025	194	0,03
100.000	EUR	Apple, Inc., 0.00%, 15/11/2025	95	0,01
650.000	EUR	Apple, Inc., 1.63%, 10/11/2026	626	0,09
250.000	EUR	Apple, Inc., 2.00%, 17/09/2027	242	0,03
350.000	EUR	Apple, Inc., 1.38%, 24/05/2029	325	0,05
200.000	EUR	Apple, Inc., 0.50%, 15/11/2031	169	0,02
150.000	EUR	Archer-Daniels-Midland Co., 1.00%, 12/09/2025	144	0,02
325.000	EUR	AT&T, Inc., 3.55%, 18/11/2025	325	0,05
150.000	EUR	AT&T, Inc., 3.50%, 17/12/2025	150	0,02
425.000	EUR	AT&T, Inc., 0.25%, 04/03/2026	401	0,06
450.000	EUR	AT&T, Inc., 1.80%, 05/09/2026	434	0,06
400.000	EUR	AT&T, Inc., 1.60%, 19/05/2028	375	0,05
300.000	EUR	AT&T, Inc., 2.35%, 05/09/2029	285	0,04
150.000	EUR	AT&T, Inc., 2.60%, 17/12/2029	144	0,02
300.000	EUR	AT&T, Inc., 0.80%, 04/03/2030	260	0,04
300.000	EUR	AT&T, Inc., 3.95%, 30/04/2031	309	0,04
200.000	EUR	AT&T, Inc., 2.05%, 19/05/2032	180	0,03
550.000	EUR	AT&T, Inc., 3.55%, 17/12/2032	553	0,08
100.000	EUR	AT&T, Inc., 3.38%, 15/03/2034	98	0,01
300.000	EUR	AT&T, Inc., 4.30%, 18/11/2034	317	0,04
250.000	EUR	AT&T, Inc., 2.45%, 15/03/2035	223	0,03
500.000	EUR	AT&T, Inc., 3.15%, 04/09/2036	469	0,07
100.000	EUR	AT&T, Inc., 2.60%, 19/05/2038	86	0,01
200.000	EUR	AT&T, Inc., 1.80%, 14/09/2039	154	0,02
200.000	EUR	Athene Global Funding, 0.37%, 10/09/2026	184	0,03
175.000	EUR	Athene Global Funding, 0.83%, 08/01/2027	161	0,02
175.000	EUR	Athene Global Funding, 0.63%, 12/01/2028	156	0,02
400.000	EUR	Autoliv, Inc., 4.25%, 15/03/2028	408	0,06
150.000	EUR	Bank of America Corp., 1.38%, 26/03/2025	147	0,02
400.000	EUR	Bank of America Corp., 4.13%, 12/06/2028	411	0,06
275.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.81%, 09/05/2026	266	0,04
400.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.95%, 27/10/2026	389	0,05
450.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.78%, 04/05/2027	433	0,06
500.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.66%, 25/04/2028	472	0,07

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.58%, 24/08/2028	181	0,03
430.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 3.65%, 31/03/2029	432	0,06
250.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.58%, 08/08/2029	222	0,03
200.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.38%, 09/05/2030	180	0,02
300.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.69%, 22/03/2031	254	0,04
600.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 0.65%, 26/10/2031	499	0,07
375.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 1.10%, 24/05/2032	317	0,04
425.000	EUR	Bank of America Corp., FRN, 2.82%, 27/04/2033	401	0,06
250.000	EUR	Baxter International, Inc., 1.30%, 15/05/2029	226	0,03
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 0.03%, 13/08/2025	95	0,01
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 1.90%, 15/12/2026	96	0,01
300.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 3.52%, 08/02/2031	301	0,04
125.000	EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp., 1.50%, 18/03/2030	114	0,02
200.000	EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp., 2.00%, 18/03/2034	180	0,03
200.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 0.00%, 12/03/2025	193	0,03
350.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 1.13%, 16/03/2027	329	0,05
300.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 2.15%, 15/03/2028	289	0,04
200.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 1.63%, 16/03/2035	170	0,02
100.000	EUR	Berkshire Hathaway, Inc., 0.50%, 15/01/2041	64	0,01
100.000	EUR	Berry Global, Inc., 1.00%, 15/01/2025	97	0,01
150.000	EUR	Berry Global, Inc., 1.50%, 15/01/2027	140	0,02
250.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 1.00%, 05/10/2026	234	0,03
250.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 1.50%, 10/04/2029	228	0,03
100.000	EUR	Blackstone Holdings Finance Co. LLC, 3.50%, 01/06/2034	100	0,01
100.000	EUR	BMW US Capital LLC, 1.00%, 20/04/2027	93	0,01
400.000	EUR	BMW US Capital LLC, 3.00%, 02/11/2027	397	0,06
300.000	EUR	BMW US Capital LLC, 3.38%, 02/02/2034	299	0,04
400.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.00%, 15/11/2026	406	0,06
250.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 1.80%, 03/03/2027	240	0,03
200.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 0.50%, 08/03/2028	180	0,03
100.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 3.63%, 12/11/2028	101	0,01
300.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.25%, 15/05/2029	313	0,04
400.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.50%, 15/11/2031	428	0,06
125.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 3.63%, 01/03/2032	127	0,02
350.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.13%, 12/05/2033	368	0,05
225.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.75%, 15/11/2034	248	0,04
150.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 3.75%, 01/03/2036	151	0,02
300.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.00%, 01/03/2044	305	0,04
400.000	EUR	BorgWarner, Inc., 1.00%, 19/05/2031	332	0,05
200.000	EUR	Boston Scientific Corp., 0.63%, 01/12/2027	182	0,03
100.000	EUR	Bristol-Myers Squibb Co., 1.00%, 15/05/2025	97	0,01
100.000	EUR	Bristol-Myers Squibb Co., 1.75%, 15/05/2035	87	0,01
100.000	EUR	Brown-Forman Corp., 1.20%, 07/07/2026	95	0,01
100.000	EUR	Capital One Financial Corp., 1.65%, 12/06/2029	89	0,01
200.000	EUR	Cargill, Inc., 3.88%, 24/04/2030	206	0,03
250.000	EUR	Carrier Global Corp., 4.13%, 29/05/2028	256	0,04
300.000	EUR	Carrier Global Corp., 4.50%, 29/11/2032	318	0,04
250.000	EUR	Caterpillar Financial Services Corp., 3.74%, 04/09/2026	253	0,04
100.000	EUR	Chubb INA Holdings LLC, 0.88%, 15/06/2027	93	0,01
300.000	EUR	Chubb INA Holdings LLC, 1.55%, 15/03/2028	280	0,04
450.000	EUR	Chubb INA Holdings LLC, 0.88%, 15/12/2029	395	0,06
100.000	EUR	Chubb INA Holdings LLC, 1.40%, 15/06/2031	88	0,01
200.000	EUR	Chubb INA Holdings LLC, 2.50%, 15/03/2038	178	0,03
400.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.13%, 10/09/2026	386	0,05
200.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.63%, 21/03/2028	187	0,03
450.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.50%, 26/10/2028	415	0,06
325.000	EUR	Citigroup, Inc., 1.25%, 10/04/2029	293	0,04
350.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 1.25%, 06/07/2026	339	0,05
515.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 1.50%, 24/07/2026	500	0,07

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
400.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 0.50%, 08/10/2027	371	0,05
300.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 3.71%, 22/09/2028	302	0,04
300.000	EUR	Citigroup, Inc., FRN, 4.11%, 22/09/2033	311	0,04
400.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.75%, 22/09/2026	378	0,05
200.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.88%, 22/09/2026	194	0,03
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.13%, 09/03/2027	95	0,01
450.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.13%, 09/03/2029	392	0,06
125.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.13%, 15/03/2029	109	0,02
175.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.40%, 06/05/2030	150	0,02
250.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.25%, 08/03/2031	222	0,03
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.50%, 09/03/2033	80	0,01
125.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.38%, 15/03/2033	99	0,01
640.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.63%, 09/03/2035	546	0,08
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.95%, 06/05/2036	77	0,01
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.10%, 02/09/2036	78	0,01
300.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 0.80%, 15/03/2040	209	0,03
100.000	EUR	Coca-Cola Co. (The), 1.00%, 09/03/2041	71	0,01
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.50%, 06/03/2026	95	0,01
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.30%, 10/11/2029	87	0,01
200.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 1.38%, 06/03/2034	172	0,02
100.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.88%, 12/11/2039	71	0,01
350.000	EUR	Comcast Corp., 0.00%, 14/09/2026	322	0,05
100.000	EUR	Comcast Corp., 0.25%, 20/05/2027	91	0,01
400.000	EUR	Comcast Corp., 0.25%, 14/09/2029	341	0,05
300.000	EUR	Comcast Corp., 0.75%, 20/02/2032	248	0,04
350.000	EUR	Comcast Corp., 1.25%, 20/02/2040	263	0,04
200.000	EUR	Computershare US, Inc., 1.13%, 07/10/2031	163	0,02
200.000	EUR	Corning, Inc., 4.13%, 15/05/2031	205	0,03
160.000	EUR	Danaher Corp., 2.10%, 30/09/2026	156	0,02
200.000	EUR	Danaher Corp., 2.50%, 30/03/2030	193	0,03
200.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 2.50%, 16/01/2026	195	0,03
100.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 1.13%, 09/04/2028	90	0,01
100.000	EUR	Discovery Communications LLC, 1.90%, 19/03/2027	96	0,01
300.000	EUR	Dover Corp., 1.25%, 09/11/2026	284	0,04
100.000	EUR	Dover Corp., 0.75%, 04/11/2027	91	0,01
310.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 0.50%, 15/03/2027	285	0,04
300.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 1.13%, 15/03/2032	251	0,04
100.000	EUR	Dow Chemical Co. (The), 1.88%, 15/03/2040	78	0,01
100.000	EUR	DXC Technology Co., 1.75%, 15/01/2026	96	0,01
100.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.63%, 02/06/2026	97	0,01
100.000	EUR	Eli Lilly & Co., 2.13%, 03/06/2030	96	0,01
400.000	EUR	Eli Lilly & Co., 0.63%, 01/11/2031	338	0,05
150.000	EUR	Eli Lilly & Co., 0.50%, 14/09/2033	121	0,02
125.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.70%, 01/11/2049	92	0,01
500.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.13%, 14/09/2051	318	0,04
150.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.38%, 14/09/2061	88	0,01
100.000	EUR	Emerson Electric Co., 1.25%, 15/10/2025	97	0,01
100.000	EUR	Emerson Electric Co., 2.00%, 15/10/2029	94	0,01
200.000	EUR	Equinix, Inc., REIT, 0.25%, 15/03/2027	180	0,03
200.000	EUR	Equinix, Inc., REIT, 1.00%, 15/03/2033	159	0,02
100.000	EUR	Euronet Worldwide, Inc., FRN, 1.38%, 22/05/2026	94	0,01
400.000	EUR	Exxon Mobil Corp., 0.84%, 26/06/2032	328	0,05
400.000	EUR	Exxon Mobil Corp., 1.41%, 26/06/2039	292	0,04
300.000	EUR	FedEx Corp., 0.45%, 05/08/2025	288	0,04
650.000	EUR	FedEx Corp., 1.63%, 11/01/2027	619	0,09
175.000	EUR	FedEx Corp., 0.45%, 04/05/2029	152	0,02
100.000	EUR	FedEx Corp., 1.30%, 05/08/2031	86	0,01
100.000	EUR	FedEx Corp., 0.95%, 04/05/2033	79	0,01
100.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 0.63%, 03/12/2025	95	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
600.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 1.50%, 21/05/2027	564	0,08
200.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 1.00%, 03/12/2028	179	0,03
225.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 2.00%, 21/05/2030	206	0,03
100.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 2.95%, 21/05/2039	92	0,01
100.000	EUR	Fiserv, Inc., 1.13%, 01/07/2027	93	0,01
100.000	EUR	Fiserv, Inc., 1.63%, 01/07/2030	89	0,01
200.000	EUR	Fiserv, Inc., 4.50%, 24/05/2031	209	0,03
150.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 3.25%, 15/09/2025	148	0,02
100.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 2.33%, 25/11/2025	97	0,01
150.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 2.39%, 17/02/2026	146	0,02
200.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 4.87%, 03/08/2027	206	0,03
100.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 6.13%, 15/05/2028	108	0,02
275.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 5.13%, 20/02/2029	288	0,04
450.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 4.45%, 14/02/2030	458	0,06
250.000	EUR	Fortive Corp., 3.70%, 15/08/2029	252	0,04
100.000	EUR	General Electric Co., 0.88%, 17/05/2025	97	0,01
200.000	EUR	General Electric Co., 1.88%, 28/05/2027	192	0,03
450.000	EUR	General Electric Co., 1.50%, 17/05/2029	412	0,06
200.000	EUR	General Electric Co., 4.13%, 19/09/2035	210	0,03
225.000	EUR	General Electric Co., 2.13%, 17/05/2037	198	0,03
300.000	EUR	General Mills, Inc., 0.13%, 15/11/2025	284	0,04
200.000	EUR	General Mills, Inc., 0.45%, 15/01/2026	189	0,03
300.000	EUR	General Mills, Inc., 3.91%, 13/04/2029	306	0,04
100.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 1.69%, 26/03/2025	98	0,01
200.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.85%, 26/02/2026	190	0,03
350.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.60%, 20/05/2027	320	0,05
275.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 4.50%, 22/11/2027	282	0,04
200.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.65%, 07/09/2028	177	0,03
325.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 4.30%, 15/02/2029	334	0,05
200.000	EUR	Global Payments, Inc., 4.88%, 17/03/2031	211	0,03
500.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.25%, 01/05/2025	487	0,07
200.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.88%, 03/06/2026	198	0,03
500.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	480	0,07
400.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.25%, 26/01/2028	356	0,05
150.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.00%, 22/03/2028	142	0,02
300.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 2.00%, 01/11/2028	283	0,04
279.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.25%, 07/02/2029	253	0,04
450.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.88%, 09/05/2029	395	0,06
200.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 4.00%, 21/09/2029	206	0,03
375.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.88%, 21/01/2030	326	0,05
275.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.00%, 12/02/2031	271	0,04
225.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.75%, 23/03/2032	181	0,03
525.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.00%, 18/03/2033	424	0,06
300.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 5.13%, 05/04/2026	307	0,04
475.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 0.63%, 05/12/2027	436	0,06
100.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 2.13%, 22/05/2030	94	0,01
350.000	EUR	Illinois Tool Works, Inc., 1.00%, 05/06/2031	303	0,04
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.88%, 31/01/2025	195	0,03
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.95%, 23/05/2025	194	0,03
150.000	EUR	International Business Machines Corp., 2.88%, 07/11/2025	149	0,02
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.25%, 29/01/2027	189	0,03
300.000	EUR	International Business Machines Corp., 3.38%, 06/02/2027	301	0,04
400.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.30%, 11/02/2028	360	0,05
150.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.75%, 07/03/2028	142	0,02
100.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.50%, 23/05/2029	92	0,01
450.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.88%, 09/02/2030	395	0,06
400.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.75%, 31/01/2031	363	0,05
250.000	EUR	International Business Machines Corp., 3.63%, 06/02/2031	255	0,04
375.000	EUR	International Business Machines Corp., 0.65%, 11/02/2032	307	0,04

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
250.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.25%, 09/02/2034	207	0,03
575.000	EUR	International Business Machines Corp., 3.75%, 06/02/2035	590	0,08
175.000	EUR	International Business Machines Corp., 1.20%, 11/02/2040	128	0,02
200.000	EUR	International Business Machines Corp., 4.00%, 06/02/2043	207	0,03
400.000	EUR	International Flavors & Fragrances, Inc., 1.80%, 25/09/2026	381	0,05
200.000	EUR	Johnson & Johnson, 1.15%, 20/11/2028	185	0,03
500.000	EUR	Johnson & Johnson, 1.65%, 20/05/2035	440	0,06
150.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 1.50%, 27/01/2025	147	0,02
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 3.00%, 19/02/2026	299	0,04
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 1.50%, 29/10/2026	287	0,04
350.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., 2.88%, 24/05/2028	345	0,05
490.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.09%, 11/03/2027	467	0,06
350.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.39%, 24/02/2028	320	0,04
750.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.64%, 18/05/2028	709	0,10
300.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.81%, 12/06/2029	281	0,04
675.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.96%, 23/03/2030	630	0,09
600.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.00%, 25/07/2031	518	0,07
675.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 4.46%, 13/11/2031	714	0,10
375.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.05%, 04/11/2032	316	0,04
325.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.60%, 17/02/2033	264	0,04
100.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 3.76%, 21/03/2034	102	0,01
200.000	EUR	Kellanova, 1.25%, 10/03/2025	195	0,03
100.000	EUR	Kellanova, 0.50%, 20/05/2029	86	0,01
100.000	EUR	Kinder Morgan, Inc., 2.25%, 16/03/2027	96	0,01
150.000	EUR	KKR Group Finance Co. V LLC, 1.63%, 22/05/2029	135	0,02
300.000	EUR	Kraft Heinz Foods Co., 2.25%, 25/05/2028	287	0,04
100.000	EUR	Kraft Heinz Foods Co., 3.50%, 15/03/2029	101	0,01
300.000	EUR	Liberty Mutual Group, Inc., 2.75%, 04/05/2026	293	0,04
100.000	EUR	Liberty Mutual Group, Inc., 4.63%, 02/12/2030	104	0,01
100.000	EUR	Linde, Inc., 1.63%, 01/12/2025	97	0,01
100.000	EUR	ManpowerGroup, Inc., 1.75%, 22/06/2026	96	0,01
300.000	EUR	ManpowerGroup, Inc., 3.50%, 30/06/2027	301	0,04
200.000	EUR	Marsh & McLennan Cos., Inc., 1.35%, 21/09/2026	190	0,03
200.000	EUR	Marsh & McLennan Cos., Inc., 1.98%, 21/03/2030	186	0,03
100.000	EUR	MassMutual Global Funding II, 3.75%, 19/01/2030	102	0,01
200.000	EUR	Mastercard, Inc., 2.10%, 01/12/2027	193	0,03
100.000	EUR	Mastercard, Inc., 1.00%, 22/02/2029	91	0,01
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.88%, 26/05/2027	96	0,01
200.000	EUR	McDonald's Corp., 1.75%, 03/05/2028	188	0,03
125.000	EUR	McDonald's Corp., 0.25%, 04/10/2028	109	0,02
400.000	EUR	McDonald's Corp., 2.38%, 31/05/2029	382	0,05
100.000	EUR	McDonald's Corp., 2.63%, 11/06/2029	97	0,01
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.50%, 28/11/2029	91	0,01
300.000	EUR	McDonald's Corp., 4.00%, 07/03/2030	309	0,04
200.000	EUR	McDonald's Corp., 3.88%, 20/02/2031	205	0,03
100.000	EUR	McDonald's Corp., 1.60%, 15/03/2031	89	0,01
150.000	EUR	McDonald's Corp., 0.88%, 04/10/2033	120	0,02
100.000	EUR	McDonald's Corp., 3.00%, 31/05/2034	96	0,01
100.000	EUR	McDonald's Corp., 4.25%, 07/03/2035	106	0,02
200.000	EUR	McDonald's Corp., 4.13%, 28/11/2035	209	0,03
250.000	EUR	McKesson Corp., 1.63%, 30/10/2026	239	0,03
300.000	EUR	Merck & Co., Inc., 1.88%, 15/10/2026	290	0,04
200.000	EUR	Merck & Co., Inc., 2.50%, 15/10/2034	192	0,03
100.000	EUR	Merck & Co., Inc., 1.38%, 02/11/2036	82	0,01
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.55%, 16/06/2027	183	0,03
100.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 4.00%, 05/04/2028	103	0,01
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.50%, 25/05/2029	175	0,02
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 3.75%, 05/12/2030	206	0,03
100.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 3.75%, 07/12/2031	103	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
125.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 3.63%, 26/03/2034	127	0,02
450.000	EUR	Microsoft Corp., 3.13%, 06/12/2028	457	0,06
100.000	EUR	Microsoft Corp., 2.63%, 02/05/2033	99	0,01
100.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 0.63%, 13/06/2025	96	0,01
100.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 1.25%, 13/06/2028	92	0,01
200.000	EUR	MMS USA Holdings, Inc., 1.75%, 13/06/2031	180	0,03
375.000	EUR	Mondelez International, Inc., 0.25%, 17/03/2028	334	0,05
100.000	EUR	Mondelez International, Inc., 0.75%, 17/03/2033	80	0,01
325.000	EUR	Mondelez International, Inc., 1.38%, 17/03/2041	232	0,03
300.000	EUR	Moody's Corp., 0.95%, 25/02/2030	263	0,04
630.000	EUR	Morgan Stanley, 1.38%, 27/10/2026	598	0,08
540.000	EUR	Morgan Stanley, 1.88%, 27/04/2027	516	0,07
175.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 2.10%, 08/05/2026	172	0,02
350.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 1.34%, 23/10/2026	337	0,05
475.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.41%, 29/10/2027	439	0,06
300.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 4.81%, 25/10/2028	312	0,04
675.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 4.66%, 02/03/2029	700	0,10
475.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.50%, 26/10/2029	414	0,06
125.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 3.79%, 21/03/2030	126	0,02
450.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 0.50%, 07/02/2031	378	0,06
350.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 2.95%, 07/05/2032	337	0,05
720.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 1.10%, 29/04/2033	596	0,08
300.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 5.15%, 25/01/2034	332	0,05
725.000	EUR	Morgan Stanley, FRN, 3.96%, 21/03/2035	737	0,10
100.000	EUR	Mylan, Inc., 2.13%, 23/05/2025	98	0,01
200.000	EUR	Nasdaq, Inc., 1.75%, 28/03/2029	185	0,03
300.000	EUR	Nasdaq, Inc., 0.88%, 13/02/2030	261	0,04
100.000	EUR	Nasdaq, Inc., 4.50%, 15/02/2032	106	0,02
200.000	EUR	Nasdaq, Inc., 0.90%, 30/07/2033	158	0,02
200.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	188	0,03
200.000	EUR	National Grid North America, Inc., 4.15%, 12/09/2027	203	0,03
100.000	EUR	National Grid North America, Inc., 1.05%, 20/01/2031	84	0,01
125.000	EUR	National Grid North America, Inc., 4.67%, 12/09/2033	133	0,02
200.000	EUR	Nestle Holdings, Inc., 0.88%, 18/07/2025	194	0,03
100.000	EUR	Netflix, Inc., FRN, 3.00%, 15/06/2025	99	0,01
400.000	EUR	Netflix, Inc., FRN, 3.63%, 15/05/2027	403	0,06
450.000	EUR	Netflix, Inc., FRN, 4.63%, 15/05/2029	476	0,07
300.000	EUR	Netflix, Inc., FRN, 3.88%, 15/11/2029	307	0,04
200.000	EUR	Netflix, Inc., FRN, 3.63%, 15/06/2030	202	0,03
400.000	EUR	New York Life Global Funding, 0.25%, 23/01/2027	369	0,05
100.000	EUR	New York Life Global Funding, 0.25%, 04/10/2028	88	0,01
100.000	EUR	New York Life Global Funding, 3.63%, 09/01/2030	102	0,01
200.000	EUR	New York Life Global Funding, 3.45%, 30/01/2031	202	0,03
200.000	EUR	Northwestern Mutual Global Funding, 4.11%, 15/03/2030	208	0,03
200.000	EUR	Oracle Corp., 3.13%, 10/07/2025	199	0,03
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 2.63%, 28/04/2026	99	0,01
150.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.75%, 18/03/2027	140	0,02
400.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.50%, 06/05/2028	361	0,05
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.88%, 18/07/2028	91	0,01
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 1.13%, 18/03/2031	88	0,01
400.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.40%, 09/10/2032	321	0,05
200.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.75%, 14/10/2033	162	0,02
100.000	EUR	PepsiCo, Inc., 0.88%, 16/10/2039	72	0,01
200.000	EUR	PepsiCo, Inc., 1.05%, 09/10/2050	127	0,02
200.000	EUR	Pfizer, Inc., 1.00%, 06/03/2027	189	0,03
200.000	EUR	PPG Industries, Inc., 1.88%, 01/06/2025	196	0,03
400.000	EUR	PPG Industries, Inc., 0.88%, 03/11/2025	384	0,05
100.000	EUR	PPG Industries, Inc., 1.40%, 13/03/2027	95	0,01
200.000	EUR	PPG Industries, Inc., 2.75%, 01/06/2029	194	0,03

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
300.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 3.25%, 02/08/2026	300	0,04
200.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 4.88%, 11/05/2027	211	0,03
150.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 1.20%, 30/10/2028	139	0,02
300.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.35%, 05/05/2030	258	0,04
150.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 3.25%, 02/08/2031	153	0,02
200.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 1.88%, 30/10/2038	171	0,02
100.000	EUR	Procter & Gamble Co. (The), 0.90%, 04/11/2041	70	0,01
200.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.25%, 10/09/2027	179	0,03
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.38%, 06/02/2028	89	0,01
300.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.88%, 05/01/2029	279	0,04
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.00%, 08/02/2029	89	0,01
200.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 3.88%, 31/01/2030	204	0,03
150.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.63%, 10/09/2031	121	0,02
450.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.50%, 16/02/2032	352	0,05
400.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 4.63%, 23/05/2033	427	0,06
200.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.50%, 08/02/2034	163	0,02
105.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.00%, 06/02/2035	79	0,01
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.00%, 16/02/2041	63	0,01
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 4.25%, 31/01/2043	101	0,01
100.000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 1.50%, 10/09/2049	60	0,01
100.000	EUR	Prologis LP, REIT, 3.00%, 02/06/2026	99	0,01
125.000	EUR	Public Storage Operating Co., REIT, 0.50%, 09/09/2030	103	0,01
200.000	EUR	Public Storage Operating Co., REIT, 0.88%, 24/01/2032	165	0,02
200.000	EUR	PVH Corp., 3.13%, 15/12/2027	196	0,03
300.000	EUR	Realty Income Corp., REIT, 4.88%, 06/07/2030	318	0,04
100.000	EUR	Realty Income Corp., REIT, 5.13%, 06/07/2034	109	0,02
100.000	EUR	RELX Capital, Inc., 1.30%, 12/05/2025	97	0,01
200.000	EUR	Revvity, Inc., 1.88%, 19/07/2026	192	0,03
300.000	EUR	Southern Power Co., 1.85%, 20/06/2026	288	0,04
100.000	EUR	Stryker Corp., 2.13%, 30/11/2027	96	0,01
200.000	EUR	Stryker Corp., 3.38%, 11/12/2028	202	0,03
300.000	EUR	Stryker Corp., 0.75%, 01/03/2029	267	0,04
100.000	EUR	Stryker Corp., 2.63%, 30/11/2030	96	0,01
500.000	EUR	Stryker Corp., 1.00%, 03/12/2031	422	0,06
250.000	EUR	Tapestry, Inc., FRN, 5.38%, 27/11/2027	259	0,04
200.000	EUR	Tapestry, Inc., FRN, 5.88%, 27/11/2031	213	0,03
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.13%, 01/03/2025	97	0,01
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 2.00%, 15/04/2025	197	0,03
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 3.20%, 21/01/2026	199	0,03
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.40%, 23/01/2026	96	0,01
500.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.45%, 16/03/2027	475	0,07
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.75%, 15/04/2027	96	0,01
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.50%, 01/03/2028	90	0,01
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.38%, 12/09/2028	93	0,01
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.95%, 24/07/2029	94	0,01
200.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 0.88%, 01/10/2031	170	0,02
400.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 2.38%, 15/04/2032	376	0,05
100.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 3.65%, 21/11/2034	103	0,01
400.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 2.88%, 24/07/2037	378	0,05
150.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.50%, 01/10/2039	114	0,02
350.000	EUR	Thermo Fisher Scientific, Inc., 1.88%, 01/10/2049	252	0,04
400.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 0.25%, 16/07/2026	374	0,05
150.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 0.13%, 05/11/2027	134	0,02
400.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 4.05%, 13/09/2029	414	0,06
200.000	EUR	Toyota Motor Credit Corp., 3.85%, 24/07/2030	206	0,03
200.000	EUR	Unilever Capital Corp., 3.30%, 06/06/2029	202	0,03
175.000	EUR	Unilever Capital Corp., 3.40%, 06/06/2033	178	0,03
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.63%, 15/11/2025	97	0,01
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.00%, 15/11/2028	91	0,01

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts			
ANLEIHEN (Fortsetzung)							
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)							
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)							
100.000	EUR	United Parcel Service, Inc., 1.50%, 15/11/2032	86	0,01			
200.000	EUR	Utah Acquisition Sub, Inc., 3.13%, 22/11/2028	195	0,03			
125.000	EUR	Veralto Corp., 4.15%, 19/09/2031	128	0,02			
300.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 3.25%, 17/02/2026	299	0,04			
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.38%, 27/10/2026	95	0,01			
500.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.88%, 08/04/2027	466	0,07			
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.38%, 02/11/2028	184	0,03			
250.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.38%, 22/03/2029	217	0,03			
650.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.25%, 08/04/2030	576	0,08			
625.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 4.25%, 31/10/2030	655	0,09			
150.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 2.63%, 01/12/2031	142	0,02			
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.88%, 19/03/2032	83	0,01			
275.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 0.75%, 22/03/2032	225	0,03			
150.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 3.50%, 28/06/2032	151	0,02			
275.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.30%, 18/05/2033	229	0,03			
225.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 4.75%, 31/10/2034	247	0,03			
300.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.13%, 19/09/2035	232	0,03			
425.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 3.75%, 28/02/2036	427	0,06			
500.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 2.88%, 15/01/2038	457	0,06			
100.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.50%, 19/09/2039	75	0,01			
200.000	EUR	Verizon Communications, Inc., 1.85%, 18/05/2040	156	0,02			
300.000	EUR	VF Corp., 4.13%, 07/03/2026	297	0,04			
100.000	EUR	VF Corp., 0.25%, 25/02/2028	85	0,01			
125.000	EUR	VF Corp., 4.25%, 07/03/2029	123	0,02			
300.000	EUR	VF Corp., 0.63%, 25/02/2032	220	0,03			
400.000	EUR	Visa, Inc., 1.50%, 15/06/2026	385	0,05			
100.000	EUR	Visa, Inc., 2.00%, 15/06/2029	95	0,01			
200.000	EUR	Visa, Inc., 2.38%, 15/06/2034	188	0,03			
250.000	EUR	Walmart, Inc., 2.55%, 08/04/2026	247	0,03			
400.000	EUR	Walmart, Inc., 4.88%, 21/09/2029	438	0,06			
200.000	EUR	Westlake Corp., 1.63%, 17/07/2029	180	0,03			
200.000	EUR	Worley US Finance Sub Ltd., FRN, 0.88%, 09/06/2026	187	0,03			
100.000	EUR	Zimmer Biomet Holdings, Inc., 1.16%, 15/11/2027	92	0,01			
300.000	EUR	Zimmer Biomet Holdings, Inc., FRN, 2.43%, 13/12/2026	292	0,04			
Vereinigte Staaten - Gesamt			102.405	14,30			
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			707.639	98,80			
Anlagen in Anleihen - Gesamt			707.639	98,80			
Anzahl der Kontrakte	Währung	Nennwert	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts	
Terminkontrakte (Futures)							
Deutschland (31. März 2023: (0,03) %)						–	–
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (31. März 2023: (0,03) %)						–	–

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	707.639	98,80
Zahlungsmittel und Bareinschüsse	196	0,03
Zahlungsmitteläquivalente		
Bestand Währung Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 0,45 %)		
14.946 EUR BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse		
Agency (Acc T0) ²	1.536	0,22
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt	<u>1.536</u>	<u>0,22</u>
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	<u>6.822</u>	<u>0,95</u>
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	<u>716.193</u>	<u>100,00</u>

Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	97,62
Investmentfonds (CIS)	0,21
Sonstige Vermögenswerte	<u>2,17</u>
Gesamtvermögen	<u>100,00</u>

¹Das Wertpapier ist unbefristet, ohne festgelegten Fälligkeitstermin. Das gegebenenfalls angezeigte Datum ist der nächste Kündigungstermin.

²Dem Fonds nahestehende Partei.

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (31. März 2023: 96,41 %)				
Australien (31. März 2023: 2,12 %)				
300.000	EUR	APA Infrastructure Ltd., 2.00%, 22/03/2027	286	0,39
400.000	EUR	Brambles Finance Ltd., 2.38%, 12/06/2024	399	0,54
500.000	EUR	Goodman Australia Finance Pty. Ltd., REIT, 1.38%, 27/09/2025	481	0,65
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.88%, 16/09/2024	99	0,14
100.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 2.00%, 28/08/2025	98	0,13
300.000	EUR	Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 1.75%, 29/03/2028	282	0,38
Australien - Gesamt			1.645	2,23
Österreich (31. März 2023: 1,22 %)				
200.000	EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 4.13%, 18/01/2027 ¹	201	0,27
100.000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 4.63%, 21/08/2029	100	0,13
175.000	EUR	Sappi Papier Holding GmbH, 3.63%, 15/03/2028	169	0,23
200.000	EUR	Volksbank Wien AG, 4.75%, 15/03/2027	206	0,28
Österreich - Gesamt			676	0,91
Belgien (31. März 2023: 0,73 %)				
300.000	EUR	Argenta Spaarbank NV, FRN, 5.38%, 29/11/2027	310	0,42
125.000	EUR	Azelis Finance NV, 5.75%, 15/03/2028	129	0,17
300.000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.13%, 14/01/2029	264	0,36
200.000	EUR	Ontex Group NV, 3.50%, 15/07/2026	197	0,27
Belgien - Gesamt			900	1,22
Britische Jungferninseln (31. März 2023: 0,58 %)				
			-	-
Dänemark (31. März 2023: 0,95 %)				
250.000	EUR	Carlsberg Breweries A/S, 3.50%, 26/11/2026	251	0,34
275.000	EUR	Danske Bank AS, FRN, 4.00%, 12/01/2027	276	0,37
200.000	EUR	H Lundbeck A/S, 0.88%, 14/10/2027	181	0,24
500.000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.25%, 17/02/2028	455	0,62
100.000	EUR	Vestas Wind Systems A/S, FRN, 4.13%, 15/06/2026	101	0,14
Dänemark - Gesamt			1.264	1,71
Finnland (31. März 2023: 1,19 %)				
450.000	EUR	Nordea Bank Abp, 4.13%, 05/05/2028	461	0,62
Finnland - Gesamt			461	0,62
Frankreich (31. März 2023: 11,70 %)				
100.000	EUR	Accor SA, FRN, 2.63%, 30/01/2025 ²	99	0,13
200.000	EUR	Accor SA, FRN, 7.25%, 01/11/2029 ^{1/2}	220	0,30
200.000	EUR	Altice France SA, 5.88%, 01/02/2027 ¹	156	0,21
200.000	EUR	Altice France SA, 11.50%, 01/02/2027 ¹	172	0,23
300.000	EUR	Arval Service Lease SA, 0.00%, 01/10/2025	284	0,38
100.000	EUR	Arval Service Lease SA, 4.75%, 22/05/2027	103	0,14
150.000	EUR	Banijay Entertainment SASU, 7.00%, 01/05/2029	158	0,21
500.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 13/03/2029	517	0,70
125.000	EUR	Banque Stellantis France SACA, 0.63%, 21/06/2024	124	0,17
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	195	0,26
200.000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 30/05/2028	182	0,25
400.000	EUR	BPCE SA, FRN, 1.63%, 02/03/2029	370	0,50
200.000	EUR	Capgemini SE, 1.00%, 18/10/2024	197	0,27
400.000	EUR	Cerba Healthcare SACA, 3.50%, 31/05/2028	347	0,47
400.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 1.00%, 22/04/2026	388	0,52

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Credit Agricole SA, FRN, 0.63%, 12/01/2028	184	0,25
300.000	EUR	Edenred SE, 3.63%, 13/12/2026	301	0,41
100.000	EUR	Elis SA, 4.13%, 24/05/2027	101	0,14
100.000	EUR	Elis SA, 3.75%, 21/03/2030 ¹	100	0,13
200.000	EUR	ELO SACA, FRN, 2.38%, 25/04/2025 ¹	196	0,27
200.000	EUR	Engie SA, FRN, 1.63%, 04/08/2025 ²	194	0,26
500.000	EUR	Getlink SE, 3.50%, 30/10/2025	496	0,67
		Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement, FRN, 0.13%, 16/09/2025	213	0,29
225.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.25%, 17/05/2024	100	0,13
100.000	EUR	JCDecaux SE, 5.00%, 11/01/2029	211	0,29
200.000	EUR	Loxam SAS, 4.50%, 15/02/2027 ¹	199	0,27
125.000	EUR	Mobilux Finance SAS, 4.25%, 15/07/2028	118	0,16
200.000	EUR	Nexans SA, 4.25%, 11/03/2030	201	0,27
300.000	EUR	Orange SA, FRN, 2.38%, 15/01/2025 ^{1/2}	295	0,40
175.000	EUR	Paprec Holding SA, 6.50%, 17/11/2027 ¹	184	0,25
150.000	EUR	Paprec Holding SA, 3.50%, 01/07/2028	143	0,19
100.000	EUR	Picard Groupe SAS, FRN, 3.88%, 01/07/2026 ¹	98	0,13
100.000	EUR	Praemia Healthcare SACA, REIT, 5.50%, 19/09/2028	105	0,14
200.000	EUR	RCI Banque SA, 1.63%, 11/04/2025	196	0,27
300.000	EUR	RCI Banque SA, 4.13%, 01/12/2025	301	0,41
275.000	EUR	Rexel SA, FRN, 2.13%, 15/06/2028	256	0,35
200.000	EUR	Schneider Electric SE, 3.38%, 06/04/2025	200	0,27
200.000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 1.00%, 24/11/2030	190	0,26
300.000	EUR	TotalEnergies SE, FRN, 1.75%, 04/04/2024 ²	300	0,41
200.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 0.63%, 04/05/2027	184	0,25
100.000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, FRN, 7.25%, 07/03/2028 ²	106	0,14
200.000	EUR	Vallourec SACA, 8.50%, 30/06/2026	202	0,27
200.000	EUR	Veolia Environnement SA, FRN, 2.50%, 20/01/2029 ²	180	0,24
200.000	EUR	Verallia SA, FRN, 1.63%, 14/05/2028	185	0,25
500.000	EUR	Vivendi SE, 0.63%, 11/06/2025 ¹	488	0,66
		Frankreich - Gesamt	9.739	13,17
Deutschland (31. März 2023: 8,21 %)				
400.000	EUR	Aareal Bank AG, 4.50%, 25/07/2025 ¹	398	0,54
175.000	EUR	Covestro AG, 0.88%, 03/02/2026	167	0,23
200.000	EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.00%, 17/12/2027	186	0,25
400.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 14/07/2024	398	0,54
200.000	EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.88%, 16/05/2027 ¹	194	0,26
200.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 17/01/2025 ¹	187	0,25
125.000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 5.00%, 05/02/2027	119	0,16
75.000	EUR	E.ON SE, 1.00%, 07/10/2025	72	0,10
225.000	EUR	E.ON SE, 3.75%, 01/03/2029	230	0,31
200.000	EUR	Evonik Industries AG, 2.25%, 25/09/2027 ¹	193	0,26
175.000	EUR	Gruenenthal GmbH, 3.63%, 15/11/2026	172	0,23
300.000	EUR	Gruenenthal GmbH, 6.75%, 15/05/2030	318	0,43
300.000	EUR	Hornbach Baumarkt AG, 3.25%, 25/10/2026 ¹	294	0,40
400.000	EUR	Infineon Technologies AG, FRN, 3.63%, 01/01/2028 ²	390	0,53
500.000	EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.38%, 28/02/2028	440	0,60
400.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.63%, 25/06/2079	393	0,53
100.000	EUR	Merck KGaA, FRN, 1.63%, 09/09/2080	94	0,13
325.000	EUR	Nidda Healthcare Holding GmbH, 7.50%, 21/08/2026	336	0,45
100.000	EUR	Novelis Sheet Ingot GmbH, 3.38%, 15/04/2029	94	0,13
300.000	EUR	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH, FRN, 1.75%, 05/07/2025	292	0,39
200.000	EUR	Schaeffler AG, 4.50%, 28/03/2030	199	0,27
375.000	EUR	TK Elevator Midco GmbH, 4.38%, 15/07/2027	362	0,49
225.000	EUR	TUI AG, FRN, 5.88%, 15/03/2029	229	0,31
175.000	EUR	TUI Cruises GmbH, 6.50%, 15/05/2026	177	0,24

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Deutschland (Fortsetzung)				
100.000	EUR	ZF Finance GmbH, 3.00%, 21/09/2025	98	0,13
400.000	EUR	ZF Finance GmbH, 2.75%, 25/05/2027	382	0,52
		Deutschland - Gesamt	6.414	8,68
Griechenland (31. März 2023: 0,94 %)				
225.000	EUR	Mytilineos SA, 2.25%, 30/10/2026	217	0,29
225.000	EUR	National Bank of Greece SA, FRN, 7.25%, 22/11/2027 ¹	244	0,33
175.000	EUR	National Bank of Greece SA, FRN, 8.00%, 03/01/2034 ¹	191	0,26
350.000	EUR	Piraeus Bank SA, FRN, 8.25%, 28/01/2027	375	0,50
		Griechenland - Gesamt	1.027	1,38
Ungarn (31. März 2023: 0,36 %)				
300.000	EUR	OTP Bank Nyrt., FRN, 5.00%, 31/01/2029	300	0,41
		Ungarn - Gesamt	300	0,41
Island (31. März 2023: 0,89 %)				
575.000	EUR	Arion Banki HF, 0.38%, 14/07/2025	547	0,74
300.000	EUR	Islandsbanki HF, 7.38%, 17/05/2026	315	0,43
		Island - Gesamt	862	1,17
Irland (31. März 2023: 2,57 %)				
200.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.00%, 25/11/2025	196	0,27
175.000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 1.88%, 05/06/2026	171	0,23
125.000	EUR	CA Auto Bank SpA, 0.00%, 16/04/2024	125	0,17
275.000	EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.00%, 11/07/2027	280	0,38
225.000	EUR	Dell Bank International DAC, 0.50%, 27/10/2026	209	0,28
300.000	EUR	Hammerson Ireland Finance DAC, REIT, FRN, 1.75%, 03/06/2027	277	0,37
600.000	EUR	James Hardie International Finance DAC, 3.63%, 01/10/2026 ¹	592	0,80
400.000	EUR	Linde plc, 0.00%, 30/09/2026	370	0,50
		Irland - Gesamt	2.220	3,00
Insel Man (31. März 2023: 0,16 %)				
100.000	EUR	Playtech plc, 4.25%, 07/03/2026	98	0,13
		Insel Man - Gesamt	98	0,13
Italien (31. März 2023: 8,21 %)				
175.000	EUR	ACEA SpA, 1.50%, 08/06/2027	166	0,22
100.000	EUR	AMCO - Asset Management Co. SpA, 4.63%, 06/02/2027	102	0,14
125.000	EUR	ASTM SpA, FRN, 1.00%, 25/11/2026	117	0,16
100.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 5.88%, 09/06/2024	100	0,14
400.000	EUR	Azzurra Aeroporti SpA, 2.13%, 30/05/2024	398	0,54
225.000	EUR	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, FRN, 4.75%, 15/03/2029 ¹	227	0,31
300.000	EUR	Banca Popolare di Sondrio SpA, FRN, 5.50%, 26/09/2028	312	0,42
100.000	EUR	Banco BPM SpA, 2.50%, 21/06/2024	100	0,14
100.000	EUR	Banco BPM SpA, 1.75%, 28/01/2025	98	0,13
250.000	EUR	Banco BPM SpA, FRN, 6.00%, 21/01/2028	263	0,36
275.000	EUR	Banco BPM SpA, FRN, 6.00%, 14/06/2028	290	0,39
200.000	EUR	Banco BPM SpA, FRN, 5.00%, 18/06/2034	199	0,27
175.000	EUR	BPER Banca, 1.88%, 07/07/2025	171	0,23
150.000	EUR	doValue SpA, 3.38%, 31/07/2026	133	0,18
225.000	EUR	Enel SpA, FRN, 3.50%, 24/02/2025 ²	223	0,30
200.000	EUR	Enel SpA, FRN, 2.25%, 12/10/2026 ²	187	0,25

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Italien (Fortsetzung)				
300.000	EUR	Eni SpA, 1.63%, 17/05/2028 ¹	280	0,38
400.000	EUR	Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1.88%, 08/07/2026 ¹	384	0,52
200.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.50%, 10/04/2024	200	0,27
325.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 04/07/2024 ¹	323	0,44
275.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 4.56%, 17/03/2025 ¹	276	0,37
225.000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 5.00%, 08/03/2028	233	0,32
400.000	EUR	Lottomatica SpA, FRN, 8.07%, 01/06/2028	405	0,55
243.000	EUR	Mundys SpA, 1.63%, 03/02/2025	237	0,32
100.000	EUR	Snam SpA, 1.25%, 28/08/2025	97	0,13
400.000	EUR	Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028	424	0,57
200.000	EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, FRN, 2.38%, 11/09/2027 ²	185	0,25
400.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 4.45%, 16/02/2029	408	0,55
200.000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 2.73%, 15/01/2032	190	0,26
100.000	EUR	Unipol Gruppo SpA, 3.00%, 18/03/2025	99	0,13
150.000	EUR	Webuild SpA, 7.00%, 27/09/2028	161	0,22
100.000	EUR	Webuild SpA, FRN, 3.88%, 28/07/2026	98	0,13
Italien - Gesamt			7.086	9,59
Japan (31. März 2023: 2,02 %)				
200.000	EUR	Nidec Corp., 0.05%, 30/03/2026	187	0,25
300.000	EUR	NTT Finance Corp., 0.08%, 13/12/2025	284	0,38
300.000	EUR	ORIX Corp., 1.92%, 20/04/2026	290	0,39
300.000	EUR	ORIX Corp., 4.48%, 01/06/2028	312	0,42
200.000	EUR	SoftBank Group Corp., 2.13%, 06/07/2024 ¹	198	0,27
200.000	EUR	SoftBank Group Corp., 2.88%, 06/01/2027 ¹	190	0,26
100.000	EUR	SoftBank Group Corp., 5.00%, 15/04/2028	100	0,14
Japan - Gesamt			1.561	2,11
Jersey (31. März 2023: 0,27 %)				
18.981	EUR	Adient Global Holdings Ltd., 3.50%, 15/08/2024	19	0,03
225.000	EUR	Kane Bidco Ltd., 5.00%, 15/02/2027 ¹	218	0,29
Jersey - Gesamt			237	0,32
Luxemburg (31. März 2023: 5,06 %)				
175.000	EUR	Altice Financing SA, 2.25%, 15/01/2025	168	0,23
200.000	EUR	Altice Financing SA, 3.00%, 15/01/2028	165	0,22
100.000	EUR	Aroundtown SA, REIT, FRN, 3.38%, 23/09/2024 ²	60	0,08
125.000	EUR	Cullinan Holdco Scsp, FRN, 4.63%, 15/10/2026	112	0,15
325.000	EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.20%, 18/03/2026	305	0,41
275.000	EUR	Herens Midco Sarl, FRN, 5.25%, 15/05/2029 ¹	182	0,25
250.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.32%, 15/12/2026	230	0,31
100.000	EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.38%, 09/04/2025 ¹	99	0,13
200.000	EUR	InPost SA, 2.25%, 15/07/2027	187	0,25
150.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 0.63%, 17/11/2025	141	0,19
200.000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 1.63%, 15/07/2027	183	0,25
125.000	EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.25%, 02/07/2025	120	0,16
100.000	EUR	Picard Bondco SA, FRN, 5.38%, 01/07/2027 ¹	98	0,13
300.000	EUR	Rossini Sarl, FRN, 7.76%, 30/10/2025 ¹	301	0,41
150.000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 1.25%, 23/03/2026	143	0,19
200.000	EUR	SES SA, 3.50%, 14/01/2029 ¹	197	0,27
200.000	EUR	SIG Combibloc PurchaseCo Sarl, 2.13%, 18/06/2025	196	0,27
200.000	EUR	SIX Finance Luxembourg SA, 0.00%, 02/12/2025	188	0,25
300.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.00%, 16/09/2025	300	0,41
300.000	EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 3.75%, 27/03/2030	300	0,41
Luxemburg - Gesamt			3.675	4,97

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (31. März 2023: 14,26 %)				
325.000	EUR	ABB Finance BV, 3.13%, 15/01/2029	326	0,44
200.000	EUR	Abertis Infraestructuras Finance BV, FRN, 3.25%, 24/11/2025 ^{1/2}	194	0,26
500.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.38%, 20/10/2028	518	0,70
175.000	EUR	Achmea BV, 3.63%, 29/11/2025	175	0,24
200.000	EUR	Aegon Bank NV, 0.63%, 21/06/2024	198	0,27
225.000	EUR	Alcon Finance BV, 2.38%, 31/05/2028	218	0,29
400.000	EUR	Ashland Services BV, 2.00%, 30/01/2028 ¹	368	0,50
400.000	EUR	ASML Holding NV, 3.50%, 06/12/2025	401	0,54
100.000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 2.75%, 23/09/2025	99	0,13
150.000	EUR	Conti-Gummi Finance BV, 1.13%, 25/09/2024	148	0,20
400.000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 4.23%, 25/04/2029	410	0,55
400.000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/09/2026	369	0,50
100.000	EUR	CTP NV, REIT, 4.75%, 05/02/2030	101	0,14
300.000	EUR	Danfoss Finance I BV, 0.13%, 28/04/2026	279	0,38
175.000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 0.63%, 15/07/2025	168	0,23
200.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 3.38%, 23/07/2028	201	0,27
200.000	EUR	Givaudan SA, 1.13%, 17/09/2025	193	0,26
225.000	EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.25%, 29/03/2026	215	0,29
100.000	EUR	Heineken NV, 2.25%, 30/03/2030 ¹	95	0,13
200.000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.87%, 28/01/2026 ²	191	0,26
350.000	EUR	IMCD NV, 2.13%, 31/03/2027	333	0,45
225.000	EUR	IMCD NV, 4.88%, 18/09/2028	234	0,32
200.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 2.13%, 23/05/2026	196	0,27
300.000	EUR	ING Groep NV, FRN, 4.88%, 14/11/2027	309	0,42
375.000	EUR	JDE Peet's NV, 0.00%, 16/01/2026	351	0,47
100.000	EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 3.50%, 04/04/2028 ¹	101	0,14
175.000	EUR	Koninklijke FrieslandCampina NV, FRN, 2.85%, 09/10/2025 ²	168	0,23
110.000	EUR	Koninklijke KPN NV, FRN, 6.00%, 21/09/2027 ^{1/2}	116	0,16
200.000	EUR	PACCAR Financial Europe BV, 3.25%, 29/11/2025	199	0,27
300.000	EUR	Phoenix PIB Dutch Finance BV, 2.38%, 05/08/2025	292	0,39
400.000	EUR	Prosus NV, 1.21%, 19/01/2026 ¹	382	0,52
300.000	EUR	RELX Finance BV, 1.50%, 13/05/2027	286	0,39
100.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 3.75%, 03/11/2026 ^{1/2}	98	0,13
200.000	EUR	Repsol International Finance BV, FRN, 2.50%, 22/12/2026 ²	189	0,25
500.000	EUR	Samvardhana Moterson Automotive Systems Group BV, 1.80%, 06/07/2024	496	0,67
425.000	EUR	Sandoz Finance BV, 3.97%, 17/04/2027	432	0,58
425.000	EUR	Signify NV, 2.00%, 11/05/2024 ¹	424	0,57
300.000	EUR	Sika Capital BV, 3.75%, 03/11/2026	302	0,41
200.000	EUR	Stellantis NV, 2.00%, 20/03/2025 ¹	197	0,27
100.000	EUR	Stellantis NV, 3.88%, 05/01/2026	101	0,14
200.000	EUR	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, FRN, 3.75%, 09/05/2027 ¹	194	0,26
175.000	EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.00%, 18/11/2025	166	0,22
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance BV, FRN, 7.65%, 15/08/2026	100	0,14
250.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.75%, 28/02/2026	239	0,32
450.000	EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.75%, 16/11/2028	426	0,58
150.000	EUR	United Group BV, 6.75%, 15/02/2031	154	0,21
350.000	EUR	Wolters Kluwer NV, 3.00%, 23/09/2026	348	0,47
Niederlande - Gesamt			11.700	15,83
Neuseeland (31. März 2023: 0,35 %)				
100.000	EUR	ASB Bank Ltd., 4.50%, 16/03/2027	103	0,14
200.000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd., 0.30%, 25/06/2024 ¹	198	0,27
Neuseeland - Gesamt			301	0,41

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Norwegen (31. März 2023: 0,26 %)				
400.000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 4.00%, 14/03/2029	409	0,55
100.000	EUR	Norsk Hydro ASA, 1.13%, 11/04/2025	97	0,13
		Norwegen - Gesamt	506	0,68
Panama (31. März 2023: 0,19 %)				
			–	–
Portugal (31. März 2023: 0,37 %)				
100.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 8.50%, 25/10/2025	102	0,14
300.000	EUR	Banco Comercial Portugues SA, FRN, 4.00%, 17/05/2032	289	0,39
		Portugal - Gesamt	391	0,53
Singapur (31. März 2023: 0,48 %)				
			–	–
Südkorea (31. März 2023: 0,32 %)				
			–	–
Spanien (31. März 2023: 4,36 %)				
100.000	EUR	Abertis Infraestructuras SA, 0.63%, 15/07/2025	96	0,13
125.000	EUR	Almirall SA, 2.13%, 30/09/2026	119	0,16
200.000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.75%, 26/11/2025	195	0,26
300.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.13%, 10/11/2028	315	0,43
200.000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 5.13%, 27/06/2034	200	0,27
300.000	EUR	Banco Santander SA, 2.50%, 18/03/2025	296	0,40
300.000	EUR	Banco Santander SA, 0.20%, 11/02/2028	266	0,36
200.000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 2.25%, 17/04/2030	195	0,26
100.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 2.25%, 12/04/2026	97	0,13
100.000	EUR	Cellnex Telecom SA, 2.88%, 18/04/2025	99	0,13
475.000	EUR	eDreams ODIGEO SA, 5.50%, 15/07/2027 ¹	472	0,64
100.000	EUR	Ibercaja Banco SA, FRN, 4.38%, 30/07/2028	102	0,14
400.000	EUR	International Consolidated Airlines Group SA, 3.75%, 25/03/2029 ¹	395	0,54
200.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 4.13%, 05/05/2028	205	0,28
200.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 4.50%, 30/06/2025 ¹	200	0,27
100.000	EUR	Unicaja Banco SA, FRN, 6.50%, 11/09/2028	106	0,14
200.000	EUR	Werfenlife SA, 0.50%, 28/10/2026	183	0,25
		Spanien - Gesamt	3.541	4,79
Schweden (31. März 2023: 3,34 %)				
125.000	EUR	Dometic Group AB, 2.00%, 29/09/2028	111	0,15
500.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.25%, 24/11/2025	498	0,67
225.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.13%, 29/06/2027	231	0,31
400.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.00%, 15/04/2025	389	0,53
200.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 05/05/2026	201	0,27
300.000	EUR	Swedbank AB, 0.20%, 12/01/2028	265	0,36
475.000	EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.13%, 08/02/2027	441	0,60
100.000	EUR	Volvo Car AB, 2.13%, 02/04/2024	100	0,14
100.000	EUR	Volvo Car AB, 2.00%, 24/01/2025	98	0,13
100.000	EUR	Volvo Treasury AB, 0.13%, 17/09/2024	98	0,13
325.000	EUR	Volvo Treasury AB, 1.63%, 26/05/2025	317	0,43
		Schweden - Gesamt	2.749	3,72
Schweiz (31. März 2023: 0,00 %)				
300.000	EUR	UBS Group AG, FRN, 0.25%, 05/11/2028	266	0,36
		Schweiz - Gesamt	266	0,36

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (31. März 2023: 6,07 %)				
450.000	EUR	3i Group plc, 4.88%, 14/06/2029	471	0,64
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 3.38%, 02/04/2025	200	0,27
200.000	EUR	Barclays plc, FRN, 1.38%, 24/01/2026	196	0,27
300.000	EUR	Canary Wharf Group Investment Holdings plc, REIT, 1.75%, 07/04/2026 ¹	257	0,35
100.000	EUR	Coca-Cola Europacific Partners plc, 1.75%, 27/03/2026	97	0,13
300.000	EUR	EC Finance plc, FRN, 3.00%, 15/10/2026 ¹	292	0,40
325.000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 3.02%, 15/06/2027	320	0,43
200.000	EUR	INEOS Finance plc, 6.63%, 15/05/2028 ¹	204	0,28
300.000	EUR	Infirma plc, FRN, 1.25%, 22/04/2028	274	0,37
200.000	EUR	Jaguar Land Rover Automotive plc, 4.50%, 15/01/2026	201	0,27
150.000	EUR	Lloyds Banking Group plc, FRN, 3.50%, 01/04/2026	150	0,20
225.000	EUR	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.25%, 03/02/2025	218	0,30
175.000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.19%, 20/01/2025	170	0,23
225.000	EUR	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026 ¹	218	0,29
400.000	EUR	NatWest Markets plc, 4.25%, 13/01/2028	412	0,56
200.000	EUR	Nomad Foods Bondco plc, 2.50%, 24/06/2028	187	0,25
200.000	EUR	OTE plc, 0.88%, 24/09/2026 ¹	188	0,25
550.000	EUR	Rolls-Royce plc, 4.63%, 16/02/2026	557	0,75
500.000	EUR	Sage Group plc (The), 3.82%, 15/02/2028	508	0,69
175.000	EUR	SIG plc, 5.25%, 30/11/2026	163	0,22
100.000	EUR	TI Automotive Finance plc, 3.75%, 15/04/2029	94	0,13
200.000	EUR	Victoria plc, 3.75%, 15/03/2028	142	0,19
Vereinigtes Königreich - Gesamt			5.519	7,47
Vereinigte Staaten (31. März 2023: 19,23 %)				
150.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 0.40%, 15/02/2027	137	0,19
175.000	EUR	Athene Global Funding, 1.24%, 08/04/2024	175	0,24
200.000	EUR	Autoliv, Inc., 4.25%, 15/03/2028	204	0,28
375.000	EUR	Avantor Funding, Inc., 2.63%, 01/11/2025 ¹	367	0,50
250.000	EUR	Baxter International, Inc., 0.40%, 15/05/2024	249	0,34
100.000	EUR	Becton Dickinson and Co., 0.03%, 13/08/2025	95	0,13
400.000	EUR	Belden, Inc., 3.38%, 15/07/2027 ¹	389	0,53
675.000	EUR	Berry Global, Inc., 1.00%, 15/01/2025	658	0,89
300.000	EUR	Blackstone Private Credit Fund, 1.75%, 30/11/2026	277	0,37
300.000	EUR	Booking Holdings, Inc., 4.00%, 15/11/2026	305	0,41
200.000	EUR	Capital One Financial Corp., 0.80%, 12/06/2024	199	0,27
100.000	EUR	Catalent Pharma Solutions, Inc., 2.38%, 01/03/2028	95	0,13
100.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.38%, 22/05/2024	100	0,13
200.000	EUR	Comcast Corp., 0.00%, 14/09/2026	184	0,25
600.000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 2.63%, 15/04/2024	600	0,81
400.000	EUR	Eli Lilly & Co., 1.63%, 02/06/2026	388	0,52
200.000	EUR	EMRLD Borrower LP, 6.38%, 15/12/2030	211	0,28
100.000	EUR	Encore Capital Group, Inc., 4.88%, 15/10/2025	99	0,13
125.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 1.74%, 19/07/2024	124	0,17
300.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 6.13%, 15/05/2028 ¹	324	0,44
200.000	EUR	General Mills, Inc., 0.13%, 15/11/2025	189	0,26
200.000	EUR	General Mills, Inc., 3.91%, 13/04/2029	204	0,28
100.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.38%, 15/05/2024 ¹	100	0,13
150.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 0.13%, 19/08/2024	148	0,20
300.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	288	0,39
200.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 0.90%, 19/11/2024	196	0,27
150.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 5.13%, 05/04/2026	154	0,21
225.000	EUR	IHG Finance LLC, FRN, 4.38%, 28/11/2029	233	0,31
125.000	EUR	IQVIA, Inc., 1.75%, 15/03/2026	120	0,16
500.000	EUR	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.64%, 18/05/2028	473	0,64
100.000	EUR	Levi Strauss & Co., 3.38%, 15/03/2027	99	0,13
300.000	EUR	Mastercard, Inc., 2.10%, 01/12/2027 ¹	290	0,39
300.000	EUR	McKesson Corp., 1.50%, 17/11/2025	290	0,39

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
200.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.38%, 09/04/2024	200	0,27
125.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	118	0,16
100.000	EUR	Netflix, Inc., FRN, 3.63%, 15/05/2027	101	0,14
175.000	EUR	Organon & Co., 2.88%, 30/04/2028	163	0,22
125.000	EUR	PPG Industries, Inc., 1.88%, 01/06/2025	122	0,17
175.000	EUR	Primo Water Holdings, Inc., 3.88%, 31/10/2028	169	0,23
300.000	EUR	Prologis LP, REIT, 3.00%, 02/06/2026	297	0,40
300.000	EUR	Silgan Holdings, Inc., 3.25%, 15/03/2025 ¹	297	0,40
100.000	EUR	Silgan Holdings, Inc., 2.25%, 01/06/2028	91	0,12
200.000	EUR	Standard Industries, Inc., 2.25%, 21/11/2026	188	0,25
Vereinigte Staaten - Gesamt			9.710	13,13
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			72.848	98,54

Supranationale Wertpapiere (31. März 2023: 0,38 %)

200.000	EUR	Clarios Global LP, 4.38%, 15/05/2026	199	0,27
Anlagen in supranationalen Wertpapieren - Gesamt			199	0,27

Anlagen in Anleihen - Gesamt

73.047 **98,81**

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte³				
Klasse Z CHF Hedged Accumulating				
Buy EUR 368,211; Sell CHF 353,229	J.P. Morgan	15.04.2024	5	0,01
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (31. März 2023: 0,00 %)			5	0,01
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (31. März 2023: 0,00 %)			5	0,01
Devisenterminkontrakte³				
Klasse D CHF Hedged Accumulating				
Buy CHF 1,428,451; Sell EUR 1,493,931	J.P. Morgan	15.04.2024	(25)	(0,04)
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (31. März 2023: (0,02) %)			(25)	(0,04)
Klasse Z CHF Hedged Accumulating				
Buy CHF 5,784,460; Sell EUR 6,049,619	J.P. Morgan	15.04.2024	(98)	(0,13)
Buy EUR 15,554; Sell CHF 15,170 ⁴	J.P. Morgan	15.04.2024	–	–
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (31. März 2023: (0,13) %)			(98)	(0,13)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (31. März 2023: (0,15) %)			(123)	(0,17)

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Anzahl der Kontrakte	Währung	Nennwert	Beschreibung	Fälligkeitstermin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Nettoinventarwerts
Terminkontrakte (Futures)						
Deutschland (31. März 2023: 0,00 %)						
29	EUR	2.900.000	Euro-Bobl	06.06.2024	21	0,03
Deutschland - Gesamt					21	0,03
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (31. März 2023: 0,00 %)					21	0,03

	Zeitwert Tsd. EUR	% des Nettoinventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	73.073	98,85
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	(123)	(0,17)
Zahlungsmittel und Bareinschüsse	145	0,20
Zahlungsmitteläquivalente		
Bestand	Währung	Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 3,11 %)
		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) ⁵
54	EUR	
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt		6
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		826
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert		73.927
		100,00

Analyse des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	98,25
Investmentfonds (CIS)	0,01
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,03
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,01
Sonstige Vermögenswerte	1,70
Gesamtvermögen	100,00

¹Wertpapier ganz oder teilweise verliehen.

²Das Wertpapier ist unbefristet, ohne festgelegten Fälligkeitstermin. Das gegebenenfalls angezeigte Datum ist der nächste Kündigungstermin.

³Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

⁴Anlagen, die weniger als 500 EUR betragen, wurden auf null abgerundet.

⁵Dem Fonds nahestehende Partei.

	Basisen gagement TSD. EUR
Derivative Finanzinstrumente	
Devisenterminkontrakte	7.794
Terminkontrakte (Futures)	3.429

BLACKROCK DIVERSIFYING FIXED INCOME FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
INVESTMENTFONDS (CIS)				
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 56,09 %)				
Irland (31. März 2023: 56,09 %)				
106.937	EUR	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse Z EUR Hedged Accumulating ¹	11.741	17,77
512.606	EUR	iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible Euro Hedged Accumulating ¹	5.040	7,63
1.083.397	EUR	iShares ESG Screened Euro Corporate Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible Euro Accumulating ¹	10.597	16,04
1.080.106	EUR	iShares ESG Screened Global Corporate Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse D EUR Hedged Accumulating ¹	9.828	14,87
		Irland - Gesamt	37.206	56,31
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW)			37.206	56,31
Gesamtanlagen in Investmentfonds (CIS)			37.206	56,31
Börsengehandelte Fonds (31. März 2023: 43,69 %)				
Irland (31. März 2023: 43,69 %)				
636.306	EUR	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ¹	3.262	4,94
97.537	EUR	iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist) ^{1/2}	8.941	13,53
28.984	EUR	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc) ¹	6.593	9,98
2.072.395	EUR	iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ¹	9.639	14,59
		Irland - Gesamt	28.435	43,04
Gesamtanlagen in börsengehandelten Fonds			28.435	43,04
			Zeitwert	% des Netto-
			Tsd. EUR	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			65.641	99,35
Zahlungsmittel			10	0,02
Zahlungsmitteläquivalente				
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 0,20 %)				
2.004	EUR	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) ¹	206	0,31
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt			206	0,31
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			212	0,32
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert			66.069	100,00
				% des Gesamt-
Analyse des Gesamtvermögens				vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind				42,98
Investmentfonds (CIS)				56,55
Sonstige Vermögenswerte				0,47
Gesamtvermögen				100,00

¹Dem Fonds nahestehende Partei.

²Wertpapier ganz oder teilweise verliehen.

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Aktien (31. März 2023: 90,91 %)				
Australien (31. März 2023: 0,43 %)				
69.688	ZAR	BHP Group Ltd. ¹	2.004	0,74
		Australien - Gesamt	2.004	0,74
Bermuda (31. März 2023: 0,22 %)				
60.072	USD	Genpact Ltd.	1.978	0,73
		Bermuda - Gesamt	1.978	0,73
Brasilien (31. März 2023: 1,52 %)				
491.550	USD	Ambev SA ADR ¹	1.217	0,45
8.985	USD	Telefonica Brasil SA ADR	90	0,03
		Brasilien - Gesamt	1.307	0,48
Cayman-Inseln (31. März 2023: 18,28 %)				
771.556	HKD	Alibaba Group Holding Ltd.	6.928	2,55
111.000	HKD	ANTA Sports Products Ltd.	1.179	0,43
83.352	HKD	Baidu, Inc. 'A'	1.094	0,40
650.000	HKD	Bosideng International Holdings Ltd.	324	0,12
799.000	HKD	China Lesso Group Holdings Ltd.	378	0,14
280.000	HKD	China Resources Land Ltd., REIT	887	0,33
1.928.000	HKD	Geely Automobile Holdings Ltd.	2.275	0,84
234.085	HKD	JD.com, Inc. 'A'	3.226	1,19
36.700	HKD	Kuaishou Technology	230	0,08
356.480	HKD	Meituan 'B'	4.408	1,62
326.000	HKD	Mint Group Ltd.	514	0,19
166.955	HKD	NetEase, Inc.	3.475	1,28
91.837	USD	NU Holdings Ltd. 'A'	1.095	0,40
9.383	USD	PDD Holdings, Inc. ADR	1.091	0,40
296.700	HKD	Tencent Holdings Ltd.	11.521	4,24
699.000	HKD	Xiaomi Corp. 'B'	1.335	0,49
392.000	HKD	Xtep International Holdings Ltd.	242	0,09
		Cayman-Inseln - Gesamt	40.202	14,79
Chile (31. März 2023: 0,00 %)				
8.799.865	CLP	Banco de Chile	974	0,36
7.754.769	CLP	Banco Santander Chile	386	0,14
284.864	CLP	Cencosud SA	497	0,18
3.899.295	CLP	Enel Americas SA	379	0,14
1.656.118	CLP	Enel Chile SA	99	0,04
11.527.681	CLP	Latam Airlines Group SA	143	0,05
12.618	CLP	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, Preference 'B'	612	0,23
		Chile - Gesamt	3.090	1,14
China (31. März 2023: 12,33 %)				
3.147.000	CNY	BOE Technology Group Co. Ltd. 'A'	1.758	0,65
100	CNY	China Construction Bank Corp. 'A' ²	–	–
379.000	HKD	China Construction Bank Corp. 'H'	229	0,08
442.000	HKD	China Life Insurance Co. Ltd. 'H'	530	0,19
630.500	HKD	China Merchants Bank Co. Ltd. 'H'	2.491	0,92
501.400	HKD	China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'	878	0,32
3.284.000	HKD	China Petroleum & Chemical Corp. 'H'	1.865	0,69
256.000	HKD	China Railway Group Ltd. 'H'	127	0,05
39.900	CNY	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai 'A'	216	0,08
3.209.000	HKD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H'	1.618	0,59
2.868.100	HKD	PetroChina Co. Ltd. 'H'	2.453	0,90
724.500	HKD	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H' ¹	3.062	1,13

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Aktien (Fortsetzung)				
China (Fortsetzung)				
393.700	CNY	SAIC Motor Corp. Ltd. 'A'	817	0,30
467.500	CNY	Weichai Power Co. Ltd. 'A'	1.075	0,40
		China - Gesamt	17.119	6,30
Griechenland (31. März 2023: 0,97 %)				
17.171	EUR	Hellenic Telecommunications Organization SA	254	0,09
		Griechenland - Gesamt	254	0,09
Hongkong (31. März 2023: 1,83 %)				
			-	-
Indien (31. März 2023: 12,32 %)				
23.828	INR	Alkem Laboratories Ltd.	1.411	0,52
17.797	INR	Apollo Tyres Ltd.	100	0,04
137.962	INR	Axis Bank Ltd.	1.731	0,64
16.908	INR	Bajaj Finance Ltd.	1.468	0,54
7.002	INR	BEML Ltd.	269	0,10
226.382	INR	Birlasoft Ltd.	2.014	0,74
166.952	INR	Canara Bank	1.166	0,43
87.059	INR	Castrol India Ltd.	194	0,07
9.869	INR	Ceat Ltd.	315	0,12
254.757	INR	Chambal Fertilisers and Chemicals Ltd.	1.048	0,39
19.338	INR	Computer Age Management Services Ltd.	675	0,25
14.161	INR	Dr Lal PathLabs Ltd.	384	0,14
80.253	INR	Firstsource Solutions Ltd.	190	0,07
13.307	INR	Great Eastern Shipping Co. Ltd. (The)	159	0,06
154.023	INR	Gujarat Pipavav Port Ltd.	393	0,14
139.995	INR	HCL Technologies Ltd.	2.594	0,95
107.153	INR	HDFC Bank Ltd.	1.858	0,68
22.739	USD	HDFC Bank Ltd. ADR	1.273	0,47
339.045	INR	ICICI Bank Ltd.	4.454	1,64
3.341	USD	ICICI Bank Ltd. ADR	88	0,03
511.798	INR	Indian Oil Corp. Ltd.	1.030	0,38
26.488	INR	Indus Towers Ltd.	92	0,03
48.683	INR	Infosys Ltd.	872	0,32
10.192	INR	JK Cement Ltd.	500	0,18
57.409	INR	Jyothy Labs Ltd.	304	0,11
628.877	INR	L&T Finance Holdings Ltd.	1.197	0,44
69.665	INR	Larsen & Toubro Ltd.	3.143	1,16
73.826	INR	Lupin Ltd.	1.435	0,53
9.972	INR	Mahanagar Gas Ltd.	164	0,06
131.938	INR	Manappuram Finance Ltd.	275	0,10
16.236	INR	Natco Pharma Ltd.	185	0,07
313.481	INR	NCC Ltd.	874	0,32
46.645	INR	PTC India Ltd.	104	0,04
57.524	INR	Reliance Industries Ltd.	2.049	0,75
2.253	INR	Shree Cement Ltd.	695	0,26
54.593	INR	State Bank of India	493	0,18
53.917	INR	Tata Consultancy Services Ltd.	2.510	0,92
106.749	INR	Triveni Turbine Ltd.	687	0,25
132.224	INR	Zydus Lifesciences Ltd.	1.599	0,59
		Indien - Gesamt	39.992	14,71
Indonesien (31. März 2023: 3,69 %)				
5.659.300	IDR	Astra International Tbk. PT	1.834	0,68
1.428.100	IDR	Bank Central Asia Tbk. PT	906	0,33
5.748.000	IDR	Bank Mandiri Persero Tbk. PT	2.615	0,96

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Aktien (Fortsetzung)				
Indonesien (Fortsetzung)				
7.578.800	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT	2.886	1,06
		Indonesien - Gesamt	8.241	3,03
Kuwait (31. März 2023: 0,43 %)				
438.468	KWD	Kuwait Finance House KSCP	1.140	0,42
		Kuwait -Gesamt	1.140	0,42
Malaysia (31. März 2023: 0,13 %)				
1.403.400	MYR	CIMB Group Holdings Bhd.	1.968	0,73
187.700	MYR	MISC Bhd.	305	0,11
1.016.200	MYR	Public Bank Bhd.	907	0,33
2.319.100	MYR	YTL Corp. Bhd.	1.286	0,47
		Malaysia - Gesamt	4.466	1,64
Marshallinseln (31. März 2023: 0,00 %)				
81.530	USD	Star Bulk Carriers Corp.	1.947	0,72
		Marshallinseln - Gesamt	1.947	0,72
Mauritius (31. März 2023: 0,00 %)				
19.888	USD	MakeMyTrip Ltd.	1.412	0,52
		Mauritius - insgesamt	1.412	0,52
Mexiko (31. März 2023: 1,27 %)				
35.445	MXN	Asea SAB de CV	175	0,06
29.376	MXN	GCC SAB de CV	350	0,13
415.533	MXN	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	1.678	0,62
		Mexiko - Gesamt	2.203	0,81
Philippinen (31. März 2023: 0,11 %)				
12	PHP	ACEN Corp. ²	–	–
5	PHP	Ayala Corp., REIT ²	–	–
		Philippinen - Gesamt	–	–
Polen (31. März 2023: 0,27 %)				
21.406	PLN	Bank Polska Kasa Opieki SA	977	0,36
89.938	PLN	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	1.338	0,49
162.216	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	1.985	0,73
		Polen - Gesamt	4.300	1,58
Katar (31. März 2023: 0,90 %)				
104.355	QAR	Industries Qatar QSC	342	0,13
384.169	QAR	Masraf Al Rayan QSC	250	0,09
41.143	QAR	Ooredoo QPSC	118	0,04
26.087	QAR	Qatar Electricity & Water Co. QSC	116	0,04
60.096	QAR	Qatar Islamic Bank SAQ	312	0,12
246.364	QAR	Qatar National Bank QPSC	959	0,35
		Katar - Gesamt	2.097	0,77
Russland (31. März 2023: 0,00 %)³				
2.082.843	RUB	Alrosa PJSC ^{2/4}	–	–
59.018	RUB	Lukoil PJSC ^{2/4}	–	–
3.024	RUB	MMC Norilsk Nickel PJSC ^{2/4}	–	–

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Aktien (Fortsetzung)				
Russland (Fortsetzung)				
43.498	RUB	Mobile TeleSystems PJSC ^{2/4}	–	–
43.510	RUB	Novatek PJSC ^{2/4}	–	–
13.465	RUB	Severstal PAO ^{2/4}	–	–
121.387	RUB	Tatneft PJSC ^{2/4}	–	–
		Russland - Gesamt	–	–
Saudi-Arabien (31. März 2023: 2,98 %)				
116.700	SAR	Al Rajhi Bank	2.587	0,95
1	SAR	Aldrees Petroleum and Transport Services Co. ²	–	–
1	SAR	Arabian Centres Co. Ltd., REIT ²	–	–
1	SAR	Bank Al-Jazira ²	–	–
126.882	SAR	Saudi Basic Industries Corp.	2.644	0,97
8.597	SAR	Saudi National Bank (The)	93	0,03
243.033	SAR	Saudi Telecom Co.	2.568	0,95
		Saudi-Arabien - Gesamt	7.892	2,90
Südafrika (31. März 2023: 1,89 %)				
96.668	ZAR	FirstRand Ltd.	315	0,12
1	ZAR	Pepkor Holdings Ltd. ²	–	–
237.803	ZAR	Standard Bank Group Ltd.	2.326	0,85
		Südafrika - Gesamt	2.641	0,97
Südkorea (31. März 2023: 9,44 %)				
4.873	KRW	AfreecaTV Co. Ltd.	426	0,16
29.559	KRW	AMOREPACIFIC Group	585	0,22
7.849	KRW	Celltrion, Inc.	1.115	0,41
41.454	KRW	Cheil Worldwide, Inc.	578	0,21
5.587	KRW	CJ Corp.	539	0,20
8.977	KRW	CJ Logistics Corp.	767	0,28
5.992	KRW	GS Holdings Corp.	215	0,08
16.601	KRW	GS Retail Co. Ltd.	251	0,09
13.518	KRW	HD Hyundai Construction Equipment Co. Ltd.	582	0,21
23.190	KRW	HD Hyundai Infracore Co. Ltd.	145	0,05
29.518	KRW	HL Mando Co. Ltd.	731	0,27
7.329	KRW	Hugel, Inc.	1.044	0,38
12.389	KRW	Hyundai Mobis Co. Ltd.	2.351	0,86
1.291	KRW	Hyundai Motor Co.	223	0,08
3.404	KRW	KCC Corp.	657	0,24
2.554	KRW	Kolon Industries, Inc.	71	0,03
9.492	KRW	Korea Electric Power Corp.	155	0,06
4.126	KRW	LG Chem Ltd.	1.346	0,50
3.943	KRW	LG Electronics, Inc.	279	0,10
1.440	KRW	LG H&H Co. Ltd.	406	0,15
27.125	KRW	LX International Corp.	545	0,20
1.864	KRW	NAVER Corp.	259	0,10
254.893	KRW	Pan Ocean Co. Ltd.	782	0,29
185.033	KRW	Samsung Electronics Co. Ltd.	11.318	4,16
1.654	KRW	Samsung SDI Co. Ltd.	579	0,21
38.104	KRW	Seegene, Inc.	681	0,25
5.512	KRW	SK Hynix, Inc.	749	0,28
27.040	KRW	SK Telecom Co. Ltd.	1.056	0,39
676	KRW	SK, Inc.	90	0,03
28.336	KRW	S-Oil Corp. ¹	1.651	0,61
		Südkorea - Gesamt	30.176	11,10

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Aktien (Fortsetzung)				
Taiwan (31. März 2023: 15,98 %)				
140.000	TWD	Arcadyan Technology Corp.	837	0,31
73.000	TWD	ASE Technology Holding Co. Ltd.	367	0,13
117.000	TWD	Asustek Computer, Inc.	1.567	0,58
477.000	TWD	Cathay Financial Holding Co. Ltd.	725	0,27
294.000	TWD	Chicony Electronics Co. Ltd.	2.042	0,75
296.000	TWD	ChipMOS Technologies, Inc.	462	0,17
198.000	TWD	Chunghwa Telecom Co. Ltd.	781	0,29
2.626.000	TWD	CTBC Financial Holding Co. Ltd.	2.710	1,00
785.000	TWD	E.Sun Financial Holding Co. Ltd.	668	0,24
304.000	TWD	Elan Microelectronics Corp.	1.494	0,55
890.000	TWD	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	4.178	1,54
55.000	TWD	Makalot Industrial Co. Ltd.	639	0,23
111.000	TWD	MediaTek, Inc.	4.136	1,52
96.000	TWD	Phison Electronics Corp.	2.122	0,78
174.000	TWD	Powertech Technology, Inc.	1.091	0,40
32.910	TWD	Poya International Co. Ltd.	510	0,19
409.000	TWD	Primax Electronics Ltd.	1.070	0,39
33.000	TWD	Quanta Computer, Inc.	302	0,11
36.000	TWD	Realtek Semiconductor Corp.	629	0,23
103.000	TWD	Sercomm Corp.	435	0,16
915.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	22.258	8,19
14.211	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ADR	1.933	0,71
260.000	TWD	United Microelectronics Corp.	424	0,16
93.000	TWD	Visual Photonics Epitaxy Co. Ltd.	492	0,18
256.000	TWD	Win Semiconductors Corp.	1.170	0,43
		Taiwan - Gesamt	53.042	19,51
Thailand (31. März 2023: 2,51 %)				
943.900	THB	Bangchak Corp. PCL NVDR	1.174	0,44
2.589.500	THB	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR	2.014	0,74
461.800	THB	PTT Exploration & Production PCL NVDR	1.933	0,71
		Thailand - Gesamt	5.121	1,89
Türkei (31. März 2023: 0,60 %)				
22.580	TRY	KOC Holding A/S	139	0,05
120.241	TRY	Migros Ticaret A/S	1.542	0,57
17.985	TRY	Turk Hava Yollari AO	166	0,06
		Türkei - Gesamt	1.847	0,68
Vereinigte Arabische Emirate (31. März 2023: 1,69 %)				
200.528	AED	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	455	0,17
263.535	AED	Aldar Properties PJSC, REIT	400	0,15
843.002	AED	Dubai Islamic Bank PJSC	1.338	0,49
72.672	AED	Emaar Development PJSC, REIT	165	0,06
323.352	AED	Emaar Properties PJSC, REIT	719	0,26
195.690	AED	Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	979	0,36
165.424	AED	First Abu Dhabi Bank PJSC	597	0,22
		Vereinigte Arabische Emirate - Gesamt	4.653	1,71
Vereinigtes Königreich (31. März 2023: 0,58 %)				
130.704	GBP	Hochschild Mining plc ¹	210	0,08
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	210	0,08

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Aktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (31. März 2023: 0,54 %)			-	-
Gesamtanlagen in Aktien			237.334	87,31

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (31. März 2023: 7,79 %)				
29.063.100	USD	Vereinigte Staaten (31. März 2023: 7,79 %) US Treasury Bill, 0.00%, 16/04/2024 ³	28.999	10,67
Vereinigte Staaten - Gesamt			28.999	10,67
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			28.999	10,67
Anlagen in Anleihen - Gesamt			28.999	10,67

Nominal- betrag	Währung	Kontrahent	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Total Return Swaps						
750.768	BRL	HSBC	Erhält die Gesamtrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Long-Positionen. Zahlt die Gesamtrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Short-Positionen. Zahlt oder erhält einen variablen Zins auf Grundlage einer festgelegten Benchmark plus/minus einem Spread in einem Bereich von 0 bis 50 Basispunkten ^(a)	10.02.2028	64	0,02
1.294.102	BRL	Merrill Lynch	Erhält die Gesamtrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Long-Positionen. Zahlt die Gesamtrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Short-Positionen. Zahlt oder erhält einen variablen Zins auf Grundlage einer festgelegten Benchmark plus/minus einem Spread in einem Bereich von 8 bis 40 Basispunkten ^(a)	15.02.2028	130	0,05
2.318.600	CNY	Goldman Sachs	Erhält die Gesamtrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Long-Positionen. Zahlt die Gesamtrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Short-Positionen. Zahlt oder erhält einen variablen Zins auf Grundlage einer festgelegten Benchmark plus/minus einem Spread in einem Bereich von 0 bis 118 Basispunkten ^(a)	17.08.2026	41	0,02
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swaps - Gesamt (31. März 2023: 0,14 %)					235	0,09

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Nominal- betrag	Währung	Kontrahent	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Total Return Swaps (Fortsetzung)						
2.816.089	BRL	HSBC	Erhält die Gesamrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Long-Positionen. Zahlt die Gesamrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Short-Positionen. Zahlt oder erhält einen variablen Zins auf Grundlage einer festgelegten Benchmark plus/minus einem Spread in einem Bereich von 0 bis 50 Basispunkten ^(a)	10.02.2028	(418)	(0,15)
2.039.059	BRL	Merrill Lynch	Erhält die Gesamrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Long-Positionen. Zahlt die Gesamrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Short-Positionen. Zahlt oder erhält einen variablen Zins auf Grundlage einer festgelegten Benchmark plus/minus einem Spread in einem Bereich von 8 bis 40 Basispunkten ^(a)	15.02.2028	(104)	(0,04)
2.434.000	CNY	Goldman Sachs	Erhält die Gesamrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Long-Positionen. Zahlt die Gesamrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Short-Positionen. Zahlt oder erhält einen variablen Zins auf Grundlage einer festgelegten Benchmark plus/minus einem Spread in einem Bereich von 0 bis 118 Basispunkten ^(a)	17.08.2026	(91)	(0,03)
11.472	SAR	HSBC	Erhält die Gesamrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Long-Positionen. Zahlt die Gesamrendite des Portfolios mit dem Total Return Swap zugrunde liegenden Short-Positionen. Zahlt oder erhält einen variablen Zins auf Grundlage einer festgelegten Benchmark plus/minus einem Spread in einem Bereich von 0 bis 50 Basispunkten ^(a)	10.02.2028	(42)	(0,02)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps - Gesamt (31. März 2023: (0,19) %)					(655)	(0,24)

(a) Benchmark und Spread werden auf der Grundlage des Landes und/oder der Währung der einzelnen zugrunde liegenden Positionen ermittelt. Es folgen die festgelegten Benchmarks, die zur Ermittlung des variablen Zinssatzes herangezogen wurden:

USD - 1D Overnight Bank Funding Rate (OBFR01)

USD - 1D Overnight Fed Funds Effective Rate (FEDL01)

Anzahl der Kontrakte	Währung	Nennwert	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Terminkontrakte (Futures)						
Vereinigte Staaten (31. März 2023: 0,08 %)					—	—
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (31. März 2023: 0,08 %)					—	—
Vereinigte Staaten (31. März 2023: 0,00 %)						
93	USD	4.650	MSCI Emerging Markets Index	21.06.2024	(26)	(0,01)
Vereinigte Staaten - Gesamt					(26)	(0,01)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (31. März 2023: 0,00 %)					(26)	(0,01)

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	266.568	98,07
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	(681)	(0,25)
Zahlungsmittel, Bareinschüsse und Barsicherheiten	6.109	2,25
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(174)	(0,07)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	271.822	100,00

Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	84,49
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	10,32
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,08
Sonstige Vermögenswerte	5,11
Gesamtvermögen	100,00

¹Wertpapier ganz oder teilweise verliehen.

²Anlagen, die weniger als 500 USD betragen, wurden auf null abgerundet.

³Prozentangabe des Nettoinventarwerts vom Vorjahr auf 0,00 % gerundet.

⁴Diese Wertpapiere wurden in Abstimmung mit der Verwaltungsgesellschaft bewertet. Diese Wertpapiere wurden zum beizulegenden Zeitwert bewertet, gemäß den Bedingungen von Kapitalmaßnahmen bepreist oder zum Ende des Berichtszeitraums ausgesetzt.

⁵Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

	Basis engagement TSD. USD
Derivative Finanzinstrumente	
Total Return Swaps	29.533
Terminkontrakte (Futures)	4.878

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Die folgende Tabelle stellt die einzelnen Komponenten des Portfolios dar, das sich aus Long-Positionen in Aktien zusammensetzt, die den jeweiligen Total Return Swaps des Portfolios zum 31. März 2024 zugrunde liegen:

Währung	Bestand	Investment	Basis- engage- ment TSD. USD	% des gesamten Basis- engage- ments des Portfolios	Währung	Bestand	Investment	Basis- engage- ment TSD. USD	% des gesamten Basis- engage- ments des Portfolios
Brasilien					Saudi-Arabien				
BRL	487.061	Ambev SA	1.215	4,11	SAR	11.472	Leejam Sports Co. JSC	668	2,26
BRL	309.866	Banco Bradesco SA, Preference	883	2,99				668	2,26
BRL	64.786	Cia Energetica de Minas Gerais, Preference		0,55				29.533	100,00
BRL	25.870	Cia Siderurgica Nacional SA	81	0,27					
BRL	2.932.612	Cogna Educacao SA	1.383	4,68					
BRL	66.179	CTEEP-Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista, Preference	328	1,11					
BRL	49.267	lochpe Maxion SA	142	0,48					
BRL	387.544	Itau Unibanco Holding SA, Preference	2.681	9,08					
BRL	1	Klabin SA	-	-					
BRL	331.523	Marcopolo SA, Preference	499	1,69					
BRL	280.682	Marfrig Global Foods SA	578	1,96					
BRL	221.847	Movida Participacoes SA	377	1,28					
BRL	350.505	Petroleo Brasileiro SA, Preference	2.616	8,86					
BRL	403.100	Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA	164	0,56					
BRL	203.051	Telefonica Brasil SA	2.045	6,92					
BRL	36.664	Ultrapar Participacoes SA	208	0,70					
BRL	460.416	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas, Preference 'A'	921	3,12					
BRL	289.044	Vale SA	3.513	11,90					
			17.797	60,26					
China									
CNY	1.281.800	Baoshan Iron & Steel Co. Ltd. 'A'	1.167	3,95					
CNY	502.200	BOE Technology Group Co. Ltd. 'A'	279	0,94					
CNY	1.393.800	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. 'A'	1.978	6,70					
CNY	1.029.100	Huatai Securities Co. Ltd. 'A'	1.981	6,71					
CNY	11.100	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	2.592	8,78					
CNY	436.100	Weichai Power Co. Ltd. 'A'	998	3,38					
CNY	98.500	Wuliangye Yibin Co. Ltd. 'A'	2.073	7,02					
			11.068	37,48					

BLACKROCK GLOBAL EQUITY SELECTION FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
INVESTMENTFONDS (CIS)				
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 68,40 %)				
Irland (31. März 2023: 21,46 %)				
18.942	EUR	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Klasse X EUR Accumulating ¹	3.163	10,29
13.798	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X USD Accumulating ¹	2.447	7,96
11.389	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating ¹	2.174	7,08
		Irland - Gesamt	7.784	25,33
Luxemburg (31. März 2023: 46,94 %)				
59.428	EUR	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Klasse X2 EUR ¹	3.477	11,32
38.155	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Klasse X2 EUR ¹	575	1,87
130.384	EUR	BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Klasse X2 EUR ¹	2.756	8,97
4.169	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Klasse X2 EUR ¹	834	2,71
3.925	USD	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Klasse X2 USD ¹	636	2,07
5.746	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Klasse X2 EUR ¹	203	0,66
47.832	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Klasse X2 USD ¹	1.183	3,85
13.074	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Klasse X2 USD ¹	1.099	3,58
1.963	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Klasse X2 USD ¹	160	0,52
26.972	USD	BlackRock Global Funds - World Real Estate Securities Fund - Klasse X2 USD ¹	351	1,14
55.115	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD ¹	1.650	5,37
		Luxemburg - Gesamt	12.924	42,06
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW)			20.708	67,39
Gesamtanlagen in Investmentfonds (CIS)			20.708	67,39
Börsengehandelte Fonds (31. März 2023: 31,85 %)				
Irland (31. März 2023: 31,85 %)				
34.092	GBP	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Anteilklasse GBP (Dist) ^{1/2}	310	1,01
365.654	EUR	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc) ¹	3.078	10,02
259.307	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	1.299	4,23
93.562	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	610	1,98
7.448	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist) ¹	296	0,96
495.704	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	4.356	14,17
23.681	EUR	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	160	0,52
		Irland - Gesamt	10.109	32,89
Gesamtanlagen in börsengehandelten Fonds			10.109	32,89
			Zeitwert	% des Netto-
			Tsd. EUR	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			30.817	100,28
Zahlungsmittel			23	0,08
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			(111)	(0,36)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert			30.729	100,00

BLACKROCK GLOBAL EQUITY SELECTION FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Analyse des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Investmentfonds (CIS)

Sonstige Vermögenswerte

Gesamtvermögen

**% des Gesamt-
vermögens**

32,41

66,39

1,20

100,00

¹ Dem Fonds nahestehende Partei.

² Wertpapier ganz oder teilweise verliehen.

BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
INVESTMENTFONDS (CIS)				
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 65,29 %)				
Irland (31. März 2023: 19,05 %)				
15.426	EUR	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Klasse X EUR Accumulating ¹	2.576	8,22
16.833	EUR	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating ¹	1.875	5,99
7.046	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X USD Accumulating ¹	1.250	3,99
7.751	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating ¹	1.479	4,72
		Irland - Gesamt	7.180	22,92
Luxemburg (31. März 2023: 46,24 %)				
79.171	USD	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Klasse X2 USD Hedged ¹	789	2,52
35.178	EUR	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Klasse X2 EUR ¹	2.058	6,57
35.567	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Klasse X2 EUR ¹	536	1,71
89.209	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Klasse X2 EUR ¹	627	2,00
70.949	EUR	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Klasse X2 EUR Hedged ¹	1.100	3,51
84.355	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund – Klasse X2 USD ¹	943	3,01
3.190	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Klasse X2 EUR ¹	638	2,04
140.912	USD	BlackRock Global Funds - US Dollar Bond Fund - Klasse X2 USD ¹	1.413	4,51
2.721	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Klasse X2 EUR ¹	96	0,31
19.339	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Klasse X2 USD ¹	478	1,53
5.330	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Klasse X2 USD ¹	448	1,43
845	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Klasse X2 USD ¹	69	0,22
12.339	USD	BlackRock Global Funds - World Real Estate Securities Fund - Klasse X2 USD ¹	160	0,51
22.842	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD ¹	684	2,18
21.977	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Klasse X2 EUR ¹	2.130	6,80
18.697	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Klasse X2 EUR ¹	1.850	5,90
		Luxemburg - Gesamt	14.019	44,75
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW)			21.199	67,67
Gesamtanlagen in Investmentfonds (CIS)			21.199	67,67

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Börsengehandelte Fonds (31. März 2023: 33,06 %)				
Irland (31. März 2023: 33,06 %)				
524.357	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ¹	2.163	6,91
206.597	EUR	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ¹	997	3,18
47.770	EUR	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ¹	155	0,50
10.180	USD	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	1.228	3,92
7.065	USD	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist) ¹	1.137	3,63
95.711	EUR	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc) ¹	407	1,30
63.989	EUR	iShares Core UK Gilts UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ¹	318	1,01
127.494	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ^{1/2}	564	1,80
93.610	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ^{1/2}	469	1,50
38.503	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	251	0,80

NM0724U-3752176-160/238

BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Börsengehandelte Fonds (Fortsetzung)				
Irland (31. März 2023: 33,06 %) (Fortsetzung)				
3.227	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist) ¹	128	0,41
214.484	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	1.885	6,02
70.541	EUR	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	477	1,52
Irland - Gesamt			10.179	32,50
Gesamtanlagen in börsengehandelten Fonds			10.179	32,50

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte³				
Buy EUR 6,703,589; Sell USD 7,249,757 ⁴	Toronto-Dominion Bank	07.05.2024	–	–
Buy USD 334,317; Sell EUR 308,283	BNP Paribas	05.04.2024	1	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (31. März 2023: 0,28 %)			1	–

Devisenterminkontrakte³				
Buy EUR 224,839; Sell USD 244,248	J.P. Morgan	05.04.2024	(1)	–
Buy EUR 6,773,807; Sell USD 7,339,826	State Street	05.04.2024	(22)	(0,07)
Buy USD 7,249,757; Sell EUR 6,712,222 ⁴	Toronto-Dominion Bank	05.04.2024	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (31. März 2023: 0,00 %)			(23)	(0,07)

	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	31.379	100,17
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	(23)	(0,07)
Zahlungsmittel	36	0,12
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(66)	(0,22)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	31.326	100,00

	% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	31,68
Investmentfonds (CIS)	65,97
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) [*]	–
Sonstige Vermögenswerte	2,35
Gesamtvermögen	100,00

¹Dem Fonds nahestehende Partei.

²Wertpapier ganz oder teilweise verliehen.

³Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

⁴Anlagen, die weniger als 500 EUR betragen, wurden auf null abgerundet.

^{*}Anlagen, die weniger als 0,005 % des Gesamtvermögens betragen, werden auf null abgerundet.

Derivative Finanzinstrumente	Basisengagement TSD. EUR
Devisenterminkontrakte	20.757

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
INVESTMENTFONDS (CIS)				
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 54,67 %)				
Irland (31. März 2023: 8,92 %)				
1.899	EUR	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Klasse X EUR Accumulating ¹	317	0,40
33.224	EUR	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating ¹	3.701	4,70
11.511	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X USD Accumulating ¹	2.041	2,59
26.789	USD	BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund – Klasse X USD Accumulating ¹	2.793	3,55
18.141	EUR	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating ¹	2.216	2,82
		Irland - Gesamt	11.068	14,06
Luxemburg (31. März 2023: 45,75 %)				
185.097	USD	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Klasse X2 USD Hedged ¹	1.844	2,34
257.258	EUR	BlackRock Global Funds - Anteilklasse Emerging Markets Local Currency Bond Fund -Klasse X2 EUR ¹	1.809	2,30
228.189	EUR	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Klasse X2 EUR Hedged ¹	3.539	4,50
129.925	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund – Klasse X2 USD ¹	1.452	1,85
330.827	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Klasse X2 EUR ¹	3.451	4,39
1.665	EUR	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Klasse X2 EUR ¹	333	0,42
6.034	EUR	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Klasse X2 EUR ¹	214	0,27
51.574	USD	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Klasse X2 USD ¹	1.275	1,62
13.843	USD	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Klasse X2 USD ¹	1.164	1,48
1.999	USD	BlackRock Global Funds - World Mining Fund - Klasse X2 USD ¹	163	0,21
25.124	USD	BlackRock Global Funds - World Real Estate Securities Fund - Klasse X2 USD ¹	326	0,41
59.842	USD	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD ¹	1.791	2,28
15.533	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Klasse X2 EUR ¹	1.880	2,39
55.001	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Klasse X2 EUR ¹	5.330	6,77
39.023	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Klasse X2 EUR ¹	3.861	4,91
15.452	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Klasse X2 EUR ¹	2.286	2,91
		Luxemburg - Gesamt	30.718	39,05
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW)			41.786	53,11
Gesamtanlagen in Investmentfonds (CIS)			41.786	53,11
Börsengehandelte Fonds (31. März 2023: 42,70 %)				
Deutschland (31. März 2023: 0,91 %)				
32.417	EUR	iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF (DE) ¹	804	1,02
		Deutschland - Gesamt	804	1,02
Irland (31. März 2023: 41,79 %)				
1.135.482	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ¹	4.684	5,95
902.655	EUR	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ^{1/2}	4.354	5,53
142.292	EUR	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ¹	463	0,59

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Börsengehandelte Fonds (Fortsetzung)				
Irland (Fortsetzung)				
32.392	USD	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ^{1/2}	3.908	4,97
15.962	USD	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist) ¹	2.569	3,27
536.045	EUR	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc) ¹	2.278	2,90
171.944	EUR	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ¹	956	1,21
		iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ^{1/2}	3.070	3,90
693.380	EUR	iShares Global Govt Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ^{1/2}	473	0,60
114.243	EUR	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	2.514	3,20
501.793	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	554	0,70
85.061	EUR	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist) ¹	352	0,45
8.847	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	7.969	10,13
906.895	EUR	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	1.222	1,55
180.709	EUR			
		Irland - Gesamt	35.366	44,95
Gesamtanlagen in börsengehandelten Fonds			36.170	45,97
Börsengehandelte Rohstoffe (31. März 2023: 1,10 %)				
Irland (31. März 2023: 1,10 %)				
20.493	USD	iShares Physical Gold ETC ¹	820	1,04
		Irland - Gesamt	820	1,04
Gesamtanlagen in börsengehandelten Rohstoffe			820	1,04
Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte³				
Buy EUR 21,015,431; Sell USD 22,727,642 ⁴	Toronto-Dominion Bank	07.05.2024	–	–
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (31. März 2023: 0,46 %)			–	–
Devisenterminkontrakte³				
Buy EUR 1,434,372; Sell USD 1,558,195	J.P. Morgan	05.04.2024	(8)	(0,01)
Buy EUR 19,536,940; Sell USD 21,169,447	State Street	05.04.2024	(63)	(0,08)
Buy USD 22,727,642; Sell EUR 21,042,496 ⁴	Toronto-Dominion Bank	05.04.2024	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (31. März 2023: 0,00 %)			(71)	(0,09)
			Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			78.776	100,12
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			(71)	(0,09)
Zahlungsmittel			22	0,03
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			(48)	(0,06)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert			78.679	100,00
Analyse des Gesamtvermögens				% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind				46,21
Investmentfonds (CIS)				52,20
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) ⁴				–
Sonstige Vermögenswerte				1,59
Gesamtvermögen				100,00

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

¹Dem Fonds nahestehende Partei.

²Wertpapier ganz oder teilweise verliehen.

³Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

⁴Anlagen, die weniger als 500 EUR betragen, wurden auf null abgerundet.

* Anlagen, die weniger als 0,005 % des Gesamtvermögens betragen, werden auf null abgerundet.

Derivative Finanzinstrumente

Devisenterminkontrakte

**Basis
engagement
TSD. EUR**

63.132

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD
Aktien (31. März 2023: 79,93 %)			
		Bermuda (31. März 2023: 0,06 %)	–
		Brasilien (31. März 2023: 0,89 %)	–
14.000	HKD	Cayman-Inseln (31. März 2023: 22,45 %)	
890.500	HKD	CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd.	2
		Shimao Group Holdings Ltd.	54
		Cayman-Inseln - Gesamt	56
		Chile (31. März 2023: 0,20 %)	–
		China (31. März 2023: 8,97 %)	–
		Griechenland (31. März 2023: 1,52 %)	–
		Hongkong (31. März 2023: 0,86 %)	–
		Indien (31. März 2023: 0,23 %)	–
		Indonesien (31. März 2023: 3,42 %)	–
		Malaysia (31. März 2023: 1,13 %)	–
		Mexiko (31. März 2023: 1,54 %)	–
		Polen (31. März 2023: 1,10 %)	–
		Katar (31. März 2023: 0,73 %)	–
814.343	RUB	Russland (31. März 2023: 0,00 %)²	
382.920	RUB	Alrosa PJSC ^{1/3}	–
		Mobile TeleSystems PJSC ^{1/3}	–
		Russland - Gesamt	–
		Saudi-Arabien (31. März 2023: 2,80 %)	–
		Südafrika (31. März 2023: 1,27 %)	–
		Südkorea (31. März 2023: 10,26 %)	–
		Taiwan (31. März 2023: 16,99 %)	–
		Thailand (31. März 2023: 2,68 %)	–
		Türkei (31. März 2023: 0,61 %)	–

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen			
Aktien (Fortsetzung)					
		Vereinigte Arabische Emirate (31. März 2023: 1,05 %)			–
		Vereinigtes Königreich (31. März 2023: 0,13 %)			–
		Vereinigte Staaten (31. März 2023: 1,04 %)			–
Gesamtanlagen in Aktien					56
<hr/>					
Bestand	Währung	Anlagen			Zeitwert Tsd. USD
ANLEIHEN					
Staatsanleihen (31. März 2023: 17,47 %)					
		Vereinigte Staaten (31. März 2023: 17,47 %)			–
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt					–
<hr/>					
Nominal- betrag	Währung	Kontrahent	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD
Total Return Swaps					
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swaps - Gesamt (31. März 2023: 0,30 %)					–
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swaps - Gesamt (31. März 2023: (0,15) %)					–
<hr/>					
Anzahl der Kontrakte	Währung	Nennwert	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD
Terminkontrakte (Futures)					
Deutschland (31. März 2023: 0,18 %)					–
Vereinigte Staaten (31. März 2023: 0,01 %)					–
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (31. März 2023: 0,19 %)					–
<hr/>					
					Zeitwert Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					56
Barmittel und Barsicherheiten					231
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(287)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					–
<hr/>					
					% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens					
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere					19,51
Sonstige Vermögenswerte					80,49
Gesamtvermögen					100,00

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

¹Diese Wertpapiere wurden in Abstimmung mit der Verwaltungsgesellschaft bewertet. Diese Wertpapiere wurden zum beizulegenden Zeitwert bewertet, gemäß den Bedingungen von Kapitalmaßnahmen bepreist oder zum Ende des Berichtszeitraums ausgesetzt.

²Prozentangabe des Nettoinventarwerts vom Vorjahr auf 0,00 % gerundet.

³Anlagen, die weniger als 500 USD betragen, wurden auf null abgerundet.

FR MULTI-ASSET FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
INVESTMENTFONDS (CIS)				
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 55,03 %)				
Irland (31. März 2023: 27,89 %)				
122.631	EUR	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating ¹	13.659	4,56
81.832	USD	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X USD Accumulating ¹	14.513	4,85
158.867	USD	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating ¹	30.322	10,12
171.276	EUR	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Klasse X EUR Accumulating ¹	21.458	7,17
63.436	USD	BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund – Klasse X USD Accumulating ¹	6.614	2,21
45.265	EUR	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating ¹	5.529	1,85
819.341	EUR	iShares Green Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible EUR Hedged Accumulating ¹	7.855	2,62
		Irland - Gesamt	99.950	33,38
Luxemburg (31. März 2023: 27,14 %)				
1.044.374	EUR	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Klasse X2 EUR ¹	15.728	5,25
30.760	EUR	BlackRock Global Funds - European Fund - Klasse X2 EUR ¹	7.755	2,59
548.189	EUR	BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund - Klasse X2 EUR Hedged ¹	7.740	2,59
334.686	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund – Klasse X2 Hedged EUR ¹	3.049	1,02
302.919	USD	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Klasse X2 USD ¹	3.038	1,01
807.988	EUR	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund - Klasse X2 EUR ¹	8.427	2,81
34.933	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Klasse X2 EUR ¹	4.228	1,41
92.922	USD	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Klasse X2 USD ¹	10.844	3,62
42.735	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund - Klasse X2 EUR ¹	4.228	1,41
36.932	EUR	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Klasse X2 EUR ¹	5.464	1,82
		Luxemburg - Gesamt	70.501	23,53
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW)			170.451	56,91
Gesamtanlagen in Investmentfonds (CIS)			170.451	56,91
Börsengehandelte Fonds (31. März 2023: 42,48 %)				
Irland (31. März 2023: 42,48 %)				
1.032.328	EUR	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ¹	4.256	1,42
4.017.492	EUR	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ¹	13.067	4,36
1.258.350	EUR	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist) ¹	5.180	1,73
28.631	EUR	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist) ¹	5.274	1,76
281.501	EUR	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc) ¹	1.196	0,40
621.270	USD	iShares Bloomberg Enhanced Roll Yield Commodity Swap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	4.220	1,41
1.227.698	EUR	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ¹	6.824	2,28
19.009	EUR	iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	3.011	1,01

NM0724U-3752176-168/238

FR MULTI-ASSET FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Börsengehandelte Fonds (Fortsetzung)				
Irland (Fortsetzung)				
5.468.994	EUR	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ¹	24.162	8,07
1.042.660	EUR	iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc) ¹	7.691	2,57
749.361	EUR	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	4.897	1,63
2.711.600	EUR	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	23.839	7,96
1.165.550	USD	iShares MSCI USA Value Factor ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	6.269	2,09
376.616	EUR	iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	2.962	0,99
1.361.232	EUR	iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc) ¹	7.357	2,46
1.537.747	EUR	iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc) ¹	6.631	2,21
		Irland - Gesamt	126.836	42,35
Gesamtanlagen in börsengehandelten Fonds			126.836	42,35

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte²				
Buy AUD 5,074,649; Sell EUR 3,063,608	Morgan Stanley	03.04.2024	2	–
Buy CAD 2,177,442; Sell EUR 1,485,849	Barclays	03.04.2024	4	–
Buy CAD 2,180,000; Sell EUR 1,487,704	BNP Paribas	03.04.2024	4	–
Buy CAD 2,180,000; Sell EUR 1,478,930	BNP Paribas	05.07.2024	9	–
Buy CAD 2,177,442; Sell EUR 1,477,471	Morgan Stanley	05.07.2024	9	–
Buy EUR 2,252,857; Sell AUD 3,725,000	Toronto-Dominion Bank	03.04.2024	3	–
Buy EUR 2,607,013; Sell AUD 4,315,155 ³	Morgan Stanley	03.04.2024	–	–
Buy EUR 2,250,192; Sell AUD 3,725,000 ³	BNP Paribas	03.04.2024	–	–
Buy EUR 2,840,708; Sell JPY 445,710,000	BNP Paribas	03.04.2024	114	0,04
Buy EUR 2,839,974; Sell JPY 445,708,088	Barclays	03.04.2024	113	0,04
Buy EUR 3,077,056; Sell USD 3,314,291	Morgan Stanley	03.04.2024	8	–
Buy EUR 2,653,834; Sell USD 2,877,146 ³	BNP Paribas	05.07.2024	–	–
Buy GBP 1,488,295; Sell EUR 1,734,510	Morgan Stanley	03.04.2024	6	–
Buy GBP 1,485,000; Sell EUR 1,730,750	BNP Paribas	03.04.2024	6	–
Buy JPY 396,370,000; Sell EUR 2,408,516	BNP Paribas	03.04.2024	17	0,01
Buy JPY 396,365,169; Sell EUR 2,408,887	Morgan Stanley	03.04.2024	16	0,01
Buy JPY 98,682,919; Sell EUR 600,038	State Street	03.04.2024	4	–
Buy USD 19,447,971; Sell EUR 17,892,693	State Street	03.04.2024	115	0,04
Buy USD 19,949,955; Sell EUR 18,359,733	Morgan Stanley	03.04.2024	112	0,04
Buy USD 17,070,000; Sell EUR 15,706,981	BNP Paribas	03.04.2024	99	0,03
Buy USD 17,070,000; Sell EUR 15,712,290	Barclays	03.04.2024	93	0,03
Buy USD 17,070,000; Sell EUR 15,715,338	HSBC	03.04.2024	90	0,03

Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (31. März 2023: 0,81 %) **824** **0,27**

Institutional SEK Hedged Accumulating

Buy EUR 5,809,007; Sell SEK 66,000,000 J.P. Morgan 15.04.2024 93 0,03

Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (31. März 2023: 0,82 %) **93** **0,03**

Institutional USD Hedged Accumulating

Buy USD 76,496,993; Sell EUR 69,935,510 J.P. Morgan 15.04.2024 862 0,29

FR MULTI-ASSET FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts		
Devisenterminkontrakte² (Fortsetzung)						
Institutional USD Hedged Accumulating (Fortsetzung)						
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (31. März 2023: 0,00 %)			862	0,29		
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (31. März 2023: 1,63 %)			1.779	0,59		
Devisenterminkontrakte²						
Buy AUD 3,345,000; Sell EUR 2,045,754	BNP Paribas	03.04.2024	(25)	(0,01)		
Buy AUD 3,345,506; Sell EUR 2,047,784	Barclays	03.04.2024	(27)	(0,01)		
Buy AUD 3,725,000; Sell EUR 2,247,479 ³	BNP Paribas	05.07.2024	-	-		
Buy AUD 3,731,777; Sell EUR 2,251,858 ³	Morgan Stanley	05.07.2024	-	-		
Buy AUD 3,725,000; Sell EUR 2,250,149	Toronto-Dominion Bank	05.07.2024	(3)	-		
Buy EUR 1,481,132; Sell CAD 2,177,442	Morgan Stanley	03.04.2024	(9)	-		
Buy EUR 1,482,590; Sell CAD 2,180,000	BNP Paribas	03.04.2024	(9)	-		
Buy EUR 1,718,714; Sell GBP 1,488,295	Barclays	03.04.2024	(22)	(0,01)		
Buy EUR 1,714,253; Sell GBP 1,485,000	BNP Paribas	03.04.2024	(23)	(0,01)		
Buy EUR 1,725,151; Sell GBP 1,485,000	BNP Paribas	05.07.2024	(6)	-		
Buy EUR 1,728,880; Sell GBP 1,488,295	Morgan Stanley	05.07.2024	(6)	-		
Buy EUR 2,433,653; Sell JPY 396,365,169	Morgan Stanley	05.07.2024	(17)	(0,01)		
Buy EUR 2,433,211; Sell JPY 396,370,000	BNP Paribas	05.07.2024	(17)	(0,01)		
Buy EUR 15,119,737; Sell USD 16,605,000	BNP Paribas	03.04.2024	(255)	(0,09)		
Buy EUR 17,918,441; Sell USD 19,644,962	Barclays	03.04.2024	(271)	(0,09)		
Buy EUR 15,105,863; Sell USD 16,609,778	State Street	03.04.2024	(274)	(0,09)		
Buy EUR 15,090,242; Sell USD 16,605,000	Toronto-Dominion Bank	03.04.2024	(285)	(0,10)		
Buy EUR 16,223,264; Sell USD 17,828,895	Morgan Stanley	03.04.2024	(284)	(0,09)		
Buy EUR 15,655,696; Sell USD 17,070,000	HSBC	05.07.2024	(89)	(0,03)		
Buy EUR 15,653,015; Sell USD 17,070,000	Barclays	05.07.2024	(92)	(0,03)		
Buy EUR 15,647,650; Sell USD 17,070,000	BNP Paribas	05.07.2024	(97)	(0,03)		
Buy EUR 15,647,194; Sell USD 17,070,000	Morgan Stanley	05.07.2024	(97)	(0,03)		
Buy EUR 15,633,988; Sell USD 17,061,662	State Street	05.07.2024	(103)	(0,03)		
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (31. März 2023: (0,16) %)			(2.011)	(0,67)		
Institutional SEK Hedged Accumulating						
Buy SEK 2,198,912,434; Sell EUR 196,673,282	J.P. Morgan	15.04.2024	(6.257)	(2,09)		
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (31. März 2023: 0,00 %)⁴			(6.257)	(2,09)		
Institutional USD Hedged Accumulating						
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (31. März 2023: (0,51) %)			-	-		
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (31. März 2023: (0,67) %)			(8.268)	(2,76)		
Anzahl der Kontrakte	Währung	Nennwert	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Terminkontrakte (Futures)						
Deutschland (31. März 2023: 0,09 %)						
65	EUR	650	EURO STOXX 50 Index	21.06.2024	103	0,03
199	EUR	19.900.000	Euro-Schatz	06.06.2024	4	-
Deutschland - Gesamt					107	0,03

FR MULTI-ASSET FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Anzahl der Kontrakte	Währung	Nennwert	Beschreibung	Fälligkeits termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Nettoinventarwerts
Terminkontrakte (Futures) (Fortsetzung)						
Japan (31. März 2023: 0,06 %)						
Vereinigte Staaten (31. März 2023: 0,13 %)						
36	USD	1.800	S&P 500 E-mini Index	21.06.2024	195	0,07
7	USD	700.000	US 10 Year Note	18.06.2024	2	-
Vereinigte Staaten - Gesamt					197	0,07
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (31. März 2023: 0,28 %)					304	0,10
Deutschland (31. März 2023: (0,21) %)						
(39)	EUR	(3.900.000)	Euro-Bund	06.06.2024	(40)	(0,01)
Deutschland - Gesamt					(40)	(0,01)
Japan (31. März 2023: (0,06) %)						
(10)	JPY	(1.000.000.000)	Japan 10 Year Bond	13.06.2024	(13)	-
Japan - Gesamt					(13)	-
Vereinigte Staaten (31. März 2023: (0,03) %)						
(54)	USD	(5.400.000)	US Long Bond	18.06.2024	(68)	(0,03)
(102)	USD	(10.200.000)	US Ultra Bond	18.06.2024	(187)	(0,06)
Vereinigte Staaten - Gesamt					(255)	(0,09)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (31. März 2023: (0,30) %)					(308)	(0,10)
					Zeitwert Tsd. EUR	% des Nettoinventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					299.370	99,95
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					(8.576)	(2,86)
Zahlungsmittel und Bareinschüsse					8.737	2,92
Zahlungsmitteläquivalente						
Bestand	Währung	Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (31. März 2023: 0,03 %)				
		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) ¹				
1.015	EUR				104	0,04
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt					104	0,04
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(138)	(0,05)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					299.497	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						39,66
Investmentfonds (CIS)						53,32
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente						0,10
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)						0,56
Sonstige Vermögenswerte						6,36
Gesamtvermögen						100,00

FR MULTI-ASSET FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

¹ Dem Fonds nahestehende Partei.

² Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

³ Anlagen, die weniger als 500 EUR betragen, wurden auf null abgerundet.

⁴ Prozentangabe des Nettoinventarwerts vom Vorjahr auf 0,00 % gerundet.

Derivative Finanzinstrumente

Devisenterminkontrakte
Terminkontrakte (Futures)

**Basis
engagement
TSD. EUR**
572.541
66.198

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen				
Australien				
6.400.000	EUR	Westpac Banking Corp., 3.70%, 16/01/2026	6.433	2,85
		Australien - Gesamt	6.433	2,85
Belgien				
2.900.000	EUR	Belfius Bank SA, 3.13%, 11/05/2026	2.851	1,26
1.800.000	EUR	Belfius Bank SA, 0.00%, 28/08/2026	1.661	0,74
		Belgien - Gesamt	4.512	2,00
Finnland				
4.700.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.25%, 24/03/2026	4.406	1,95
		Finnland - Gesamt	4.406	1,95
Frankreich				
7.300.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 11/05/2026	6.795	3,01
1.500.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.75%, 27/01/2026	1.472	0,65
3.900.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.13%, 11/06/2026	3.703	1,64
1.500.000	EUR	BNP Paribas SA, 2.88%, 01/10/2026	1.470	0,65
6.500.000	EUR	BPCE SA, 3.63%, 17/04/2026	6.518	2,88
1.500.000	EUR	Credit Agricole SA, 2.85%, 27/04/2026	1.469	0,65
6.900.000	EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.63%, 15/04/2026	6.656	2,95
500.000	EUR	RCI Banque SA, 4.63%, 13/07/2026	508	0,22
3.000.000	EUR	Renault SA, 2.38%, 25/05/2026	2.899	1,28
		Frankreich - Gesamt	31.490	13,93
Deutschland				
4.300.000	EUR	Commerzbank AG, 4.00%, 23/03/2026	4.306	1,91
4.200.000	EUR	Deutsche Bank AG, 2.63%, 12/02/2026	4.116	1,82
1.500.000	EUR	Deutsche Bank AG, 4.50%, 19/05/2026	1.513	0,67
5.000.000	EUR	Fresenius SE & Co. KGaA, 4.25%, 28/05/2026	5.054	2,24
6.500.000	EUR	RWE AG, 2.13%, 24/05/2026	6.337	2,80
2.100.000	EUR	Vonovia SE, REIT, 1.38%, 28/01/2026	2.011	0,89
1.500.000	EUR	ZF Finance GmbH, 5.75%, 03/08/2026	1.546	0,68
		Deutschland - Gesamt	24.883	11,01
Italien				
5.800.000	EUR	A2A SpA, 2.50%, 15/06/2026	5.666	2,51
5.500.000	EUR	ASTM SpA, FRN, 1.00%, 25/11/2026	5.151	2,28
3.300.000	EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.75%, 26/06/2026	3.164	1,40
		Italien - Gesamt	13.981	6,19
Japan				
4.700.000	EUR	Nissan Motor Co. Ltd., 2.65%, 17/03/2026 ¹	4.584	2,03
		Japan - Gesamt	4.584	2,03
Luxemburg				
4.500.000	EUR	Highland Holdings Sarl, 0.32%, 15/12/2026	4.140	1,83
		Luxemburg - Gesamt	4.140	1,83
Niederlande				
5.500.000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.63%, 10/01/2026	5.525	2,45
2.500.000	EUR	de Volksbank NV, 0.25%, 22/06/2026	2.322	1,03

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
7.300.000	EUR	Enel Finance International NV, FRN, 0.00%, 28/05/2026	6.781	3,00
1.500.000	EUR	Naturgy Finance BV, 1.25%, 19/04/2026	1.434	0,63
1.900.000	EUR	Sartorius Finance BV, 4.25%, 14/09/2026	1.922	0,85
5.200.000	EUR	Sika Capital BV, 3.75%, 03/11/2026	5.244	2,32
2.000.000	EUR	ZF Europe Finance BV, 2.00%, 23/02/2026	1.916	0,85
Niederlande - Gesamt			25.144	11,13
Spanien				
6.500.000	EUR	Banco Santander SA, 3.25%, 04/04/2026	6.421	2,84
2.000.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 27/03/2026	1.907	0,84
1.200.000	EUR	CaixaBank SA, 1.38%, 19/06/2026	1.141	0,51
2.000.000	EUR	CaixaBank SA, 1.13%, 12/11/2026	1.875	0,83
5.000.000	EUR	Cellnex Finance Co. SA, 0.75%, 15/11/2026	4.650	2,06
Spanien - Gesamt			15.994	7,08
Schweden				
2.500.000	EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.05%, 15/04/2026	2.327	1,03
4.300.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.00%, 09/11/2026	4.344	1,92
4.100.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 05/05/2026	4.128	1,83
Schweden - Gesamt			10.799	4,78
Schweiz				
6.900.000	EUR	Credit Suisse AG, 1.50%, 10/04/2026	6.625	2,93
Schweiz - Gesamt			6.625	2,93
Vereinigtes Königreich				
2.600.000	EUR	Anglo American Capital plc, 1.63%, 11/03/2026	2.507	1,11
6.800.000	EUR	British Telecommunications plc, 1.75%, 10/03/2026	6.574	2,91
4.300.000	EUR	DS Smith plc, FRN, 0.88%, 12/09/2026	4.031	1,78
5.000.000	EUR	Experian Finance plc, 1.38%, 25/06/2026	4.775	2,11
6.750.000	EUR	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.38%, 09/04/2026	6.608	2,92
1.200.000	EUR	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	1.163	0,52
7.000.000	EUR	NatWest Markets plc, 0.13%, 18/06/2026	6.517	2,88
Vereinigtes Königreich - Gesamt			32.175	14,23
Vereinigte Staaten				
2.000.000	EUR	American Tower Corp., REIT, 1.95%, 22/05/2026	1.925	0,85
5.800.000	EUR	Citigroup, Inc., 2.13%, 10/09/2026	5.609	2,48
4.600.000	EUR	Ford Motor Credit Co. LLC, 2.39%, 17/02/2026	4.474	1,98
4.500.000	EUR	General Motors Financial Co., Inc., 0.85%, 26/02/2026	4.276	1,89
5.800.000	EUR	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	5.572	2,47
4.100.000	EUR	Harley-Davidson Financial Services, Inc., 5.13%, 05/04/2026	4.203	1,86
5.700.000	EUR	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	5.374	2,38
6.900.000	EUR	Wells Fargo & Co., 2.00%, 27/04/2026	6.677	2,95
Vereinigte Staaten - Gesamt			38.110	16,86
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			223.276	98,80
Anlagen in Anleihen - Gesamt			223.276	98,80

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte²				
Buy CHF 3,103; Sell EUR 3,176 ³	J.P. Morgan	30.04.2024	–	–
Buy USD 17,518; Sell EUR 16,193 ³	J.P. Morgan	30.04.2024	–	–
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt			–	–
Klasse C USD Hedged Accumulating				
Buy USD 2,446,681; Sell EUR 2,236,818	J.P. Morgan	15.04.2024	28	0,01
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt			28	0,01
Klasse C USD Hedged Distributing				
Buy USD 2,517,531; Sell EUR 2,301,591	J.P. Morgan	15.04.2024	28	0,01
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt			28	0,01
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt			56	0,02
Devisenterminkontrakte²				
Klasse C CHF Hedged Accumulating				
Buy CHF 173,941; Sell EUR 182,019	J.P. Morgan	15.04.2024	(3)	–
Nicht realisierter Verlust - Gesamt			(3)	–
Klasse C CHF Hedged Distributing				
Buy CHF 429,390; Sell EUR 449,330	J.P. Morgan	15.04.2024	(8)	–
Nicht realisierter Verlust - Gesamt			(8)	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt			(11)	–
			Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			223.332	98,82
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			(11)	–
Zahlungsmittel			26	0,01
Zahlungsmitteläquivalente				
Bestand	Währung	Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW)		
4.669	EUR	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) ⁴	480	0,21
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt			480	0,21
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			2.164	0,96
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert			225.991	100,00
Analyse des Gesamtvermögens				% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind				98,54
Investmentfonds (CIS)				0,21
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)				0,02
Sonstige Vermögenswerte				1,23
Gesamtvermögen				100,00

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 31. März 2024

¹Wertpapier ganz oder teilweise verliehen.

²Devisenterminkontrakte, die bei einem Kontrahenten mit der gleichen Kaufwährung, Verkaufswährung und Fälligkeit gehalten werden, werden gegebenenfalls als Summe ausgewiesen. Aktiv- und Passivpositionen werden nicht verrechnet.

³Anlagen, die weniger als 500 EUR betragen, wurden auf null abgerundet.

⁴Dem Fonds nahestehende Partei.

Derivative Finanzinstrumente

Devisenterminkontrakte

**Basisen
gagement
TSD. EUR**

5.236

BLACKROCK CANGRANDE GLOBAL INDEX EQUITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
2.599	iShares Core S&P 500 UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.067
58.847	iShares Emerging Markets Index Fund (IE) - Klasse Euro Flexible Accumulating	971
83.411	iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	645
25.715	iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Klasse US Dollar Flexible Accumulating	482
66.948	iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	459
22.209	iShares MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	115
15.419	iShares MSCI Europe ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	106
507	iShares MSCI Canada UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	75
1.022	iShares Pacific Index Fund (IE) - Klasse US Dollar Flexible Accumulating	55

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
5.409	iShares Developed World ESG Screened Index Fund (IE) - Klasse US Dollar Flexible Accumulating	104
6.825	iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	52

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
473.632	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	47.780
1.000.000	Volkswagen Financial Services AG, 2.25%, 01/10/2027	966
800.000	UBS Group AG, FRN, 7.75%, 01/03/2029	888
800.000	Bouygues SA, 3.88%, 17/07/2031	804
800.000	Volkswagen International Finance NV, 1.88%, 30/03/2027	767
725.000	Morgan Stanley, FRN, 3.96%, 21/03/2035	733
700.000	Banco Santander SA, 4.88%, 18/10/2031	717
700.000	Banco Santander SA, FRN, 5.75%, 23/08/2033	713
750.000	Anheuser-Busch InBev SA, 2.88%, 02/04/2032	713
675.000	JPMorgan Chase & Co., FRN, 4.46%, 13/11/2031	701
675.000	Bayer AG, 4.63%, 26/05/2033	686
700.000	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	670
700.000	Volkswagen International Finance NV, FRN, 3.88%, 14/06/2027	668
650.000	Bayer AG, 4.25%, 26/08/2029	653
650.000	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.50%, 30/05/2026	649
650.000	Stellantis NV, 4.25%, 16/06/2031	648
650.000	AT&T, Inc., 3.55%, 17/12/2032	630
600.000	ING Groep NV, FRN, 4.88%, 14/11/2027	619
600.000	Intesa Sanpaolo SpA, 5.13%, 29/08/2031	615
600.000	Nationwide Building Society, 4.50%, 01/11/2026	613

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
481.300	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	48.554
740.000	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.38%, 27/03/2025	734
500.000	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FRN, 2.26%, 14/06/2025	490
500.000	TotalEnergies SE, FRN, 2.63%, 26/02/2025	489
525.000	Medtronic Global Holdings SCA, 0.00%, 15/10/2025	485
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 07/03/2025	484
500.000	Wells Fargo & Co., 1.63%, 02/06/2025	476
500.000	BNP Paribas SA, FRN, 2.13%, 23/01/2027	470
500.000	Berkshire Hathaway, Inc., 2.15%, 15/03/2028	467
500.000	BPCE SA, 0.25%, 15/01/2026	455
450.000	AT&T, Inc., 3.55%, 17/12/2032	426
450.000	Anheuser-Busch InBev SA, 2.88%, 02/04/2032	421
450.000	Wells Fargo & Co., 1.50%, 24/05/2027	406
450.000	Airbus SE, 1.63%, 09/06/2030	399
400.000	BPCE SA, 4.38%, 13/07/2028	397
400.000	Banco Santander SA, 2.50%, 18/03/2025	395
400.000	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, REIT, 2.00%, 24/03/2025	390
400.000	ING Groep NV, FRN, 0.13%, 29/11/2025	390
400.000	DNB Bank ASA, FRN, 3.13%, 21/09/2027	388
400.000	Intesa Sanpaolo SpA, 1.00%, 04/07/2024	388

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK EURO SOVEREIGN BOND INDEX FUND 1

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
8.822	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	879
187.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.30%, 15/02/2033	186
170.000	France Government Bond OAT, 2.50%, 24/09/2026	168
170.000	Bundesschatzanweisungen, 2.50%, 13/03/2025	168
151.000	France Government Bond OAT, 0.25%, 25/11/2026	138
131.000	Bundesobligation, 2.20%, 13/04/2028	130
140.000	Netherlands Government Bond, 0.75%, 15/07/2027	130
130.000	Spain Government Bond, 2.80%, 31/05/2026	129
120.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033	122
110.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025	110
110.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.85%, 15/12/2029	110
122.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.80%, 15/08/2053	105
109.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 01/12/2025	105
108.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	103
95.000	Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033	96
90.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.80%, 01/08/2028	91
82.000	France Government Bond OAT, 3.00%, 25/05/2033	82
100.000	Latvia Government Bond, 0.25%, 23/01/2030	81
78.000	France Government Bond OAT, 3.00%, 25/05/2054	73
70.000	Bundesschatzanweisungen, 2.80%, 12/06/2025	70
80.000	Austria Government Bond, 0.90%, 20/02/2032	68
82.000	France Government Bond OAT, 2.00%, 25/05/2048	64
60.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.35%, 01/11/2033	61
69.000	Spain Government Bond, 0.80%, 30/07/2029	60
60.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.10%, 15/11/2029	60
65.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/08/2028	58
61.000	Bundesobligation, 0.00%, 10/10/2025	57
50.000	France Government Bond OAT, 2.75%, 25/02/2029	50
50.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.70%, 15/06/2030	50
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
950.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.50%, 01/11/2027	1.059
10.455	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	1.042
886.000	France Government Bond OAT, 5.50%, 25/04/2029	1.004
807.000	France Government Bond OAT, 3.50%, 25/04/2026	816
851.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2025	810
685.000	Spain Government Bond, 6.00%, 31/01/2029	776
812.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2026	757
660.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.00%, 01/05/2031	750
789.000	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	718
776.000	France Government Bond OAT, 0.75%, 25/11/2028	698
645.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.25%, 01/11/2029	695
690.000	France Government Bond OAT, 2.75%, 25/10/2027	688
800.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2030	653
645.000	France Government Bond OAT, 2.50%, 25/05/2030	631
580.000	Spain Government Bond, 5.90%, 30/07/2026	627
540.000	France Government Bond OAT, 6.00%, 25/10/2025	571
468.000	France Government Bond OAT, 5.75%, 25/10/2032	571
651.000	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/05/2029	567
625.000	France Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	564
583.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.50%, 15/02/2025	561

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK UK CREDIT SCREENED FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. GBP
104.779	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Dis)	10.474
1.200.000	UK Treasury, 3.25%, 31/01/2033	1.091
500.000	Danske Bank AS, FRN, 4.63%, 13/04/2027	472
400.000	Deutsche Bank AG, FRN, 6.13%, 12/12/2030	381
400.000	Volkswagen International Finance NV, 4.13%, 17/11/2031	349
300.000	UK Treasury, 4.25%, 07/06/2032	322
350.000	Next Group plc, 3.63%, 18/05/2028	316
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.38%, 25/05/2028	299
300.000	International Distributions Services plc, FRN, 7.38%, 14/09/2030	299
300.000	Banco Santander SA, 5.13%, 25/01/2030	285
300.000	Severn Trent Utilities Finance plc, 4.88%, 24/01/2042	284
325.000	Pearson Funding plc, FRN, 3.75%, 04/06/2030	282
300.000	DNB Bank ASA, FRN, 2.63%, 10/06/2026	278
275.000	Yorkshire Building Society, FRN, 6.38%, 15/11/2028	274
250.000	Whitbread Group plc, 3.00%, 31/05/2031	201
200.000	American Honda Finance Corp., 5.60%, 06/09/2030	200
200.000	Credit Agricole SA, FRN, 6.38%, 14/06/2031	199
200.000	Engie SA, 5.63%, 03/04/2053	199
200.000	Rentokil Initial plc, 5.00%, 27/06/2032	196
200.000	Compass Group plc, 4.38%, 08/09/2032	188
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. GBP
111.978	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Dis)	11.194
1.785.000	UK Treasury, 4.25%, 07/06/2032	1.804
1.300.000	Bank of America Corp., 7.00%, 31/07/2028	1.384
1.175.000	DNB Bank ASA, FRN, 2.63%, 10/06/2026	1.118
1.200.000	UK Treasury, 3.25%, 31/01/2033	1.112
1.125.000	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.99%, 28/04/2026	1.046
1.100.000	BNP Paribas SA, 1.88%, 14/12/2027	938
950.000	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.88%, 13/02/2026	888
850.000	Heathrow Funding Ltd., 6.45%, 10/12/2033	888
1.000.000	Metropolitan Life Global Funding I, 1.63%, 12/10/2028	860
1.000.000	Banco Santander SA, 1.75%, 17/02/2027	854
863.000	BP Capital Markets plc, FRN, 4.25%, 22/03/2027	794
823.000	Kraft Heinz Foods Co, 4.13%, 01/07/2027	789
900.000	American Honda Finance Corp., 1.50%, 19/10/2027	782
775.000	Koninklijke KPN NV, 5.75%, 17/09/2029	777
800.000	Banco Santander SA, 5.13%, 25/01/2030	774
850.000	McKesson Corp., 3.13%, 17/02/2029	754
800.000	E.ON International Finance BV, 4.75%, 31/01/2034	748
800.000	Barclays plc, 3.25%, 12/02/2027	739
700.000	E.ON International Finance BV, 6.13%, 06/07/2039	716

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
258.403	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	25.982
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.13%, 13/03/2029	505
500.000	Sage Group plc (The), 3.82%, 15/02/2028	502
500.000	ABN AMRO Bank NV, 4.38%, 20/10/2028	500
500.000	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.00%, 17/12/2027	461
500.000	JPMorgan Chase & Co., FRN, 1.64%, 18/05/2028	455
450.000	Nordea Bank Abp, 4.13%, 05/05/2028	449
450.000	3i Group plc, 4.88%, 14/06/2029	443
425.000	Sandoz Finance BV, 3.97%, 17/04/2027	425
500.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.38%, 28/02/2028	424
400.000	DNB Bank ASA, FRN, 4.00%, 14/03/2029	404
400.000	Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028	403
400.000	Lottomatica SpA, FRN, 8.07%, 01/06/2028	403
400.000	ASML Holding NV, 3.50%, 06/12/2025	400
400.000	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 4.23%, 25/04/2029	399
400.000	Azzurra Aeroporti SpA, 2.13%, 30/05/2024	389
400.000	UniCredit SpA, FRN, 4.45%, 16/02/2029	388
400.000	International Consolidated Airlines Group SA, 3.75%, 25/03/2029	355
400.000	BPCE SA, FRN, 1.63%, 02/03/2029	353
325.000	ABB Finance BV, 3.13%, 15/01/2029	325
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
284.756	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	28.630
600.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0.38%, 17/10/2023	591
600.000	Pernod Ricard SA, 0.00%, 24/10/2023	591
500.000	IQVIA, Inc., 2.88%, 15/09/2025	485
500.000	Thermo Fisher Scientific ,Inc., 0.75%, 12/09/2024	482
400.000	ASTM SpA, FRN, 3.38%, 13/02/2024	398
400.000	Stryker Corp., 1.13%, 30/11/2023	394
400.000	American Honda Finance Corp., 1.95%, 18/10/2024	391
400.000	Iberdrola Finanzas SA, 0.88%, 16/06/2025	379
400.000	MMS USA Holdings, Inc., 0.63%, 13/06/2025	376
400.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, FRN, 3.75%, 09/05/2027	363
350.000	Coty, Inc., 3.88%, 15/04/2026	342
350.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025	341
350.000	NGG Finance plc, FRN, 1.63%, 05/12/2079	334
325.000	Snam SpA, 0.00%, 12/05/2024	313
300.000	Eni SpA, 1.75%, 18/01/2024	296
300.000	Vivendi SE, 1.13%, 24/11/2023	296
300.000	Santander Consumer Finance SA, 0.38%, 17/01/2025	292
300.000	Arkema SA, FRN, 2.75%, 17/06/2024	291
300.000	voestalpine AG, 1.38%, 27/09/2024	289

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK DEVELOPED MARKETS SOVEREIGN SCREENED BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
17.420.000	Bundesschatzanweisungen, 2.80%, 12/06/2025	17.314
17.000.000	Bundesschatzanweisungen, 3.10%, 12/12/2025	17.011
17.000.000	Bundesschatzanweisungen, 3.10%, 18/09/2025	16.985
17.000.000	Bundesschatzanweisungen, 2.50%, 19/03/2026	16.853
17.000.000	Bundesschatzanweisungen, 2.50%, 13/03/2025	16.848
19.400.000	China Government Bond, 2.80%, 15/11/2032	2.499
14.100.000	China Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	1.847
10.000.000	China Government Bond, 2.75%, 17/02/2032	1.314
1.390.000	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2025	789
5.200.000	China Government Bond, 3.32%, 15/04/2052	705
5.200.000	China Government Bond, 2.80%, 24/03/2029	689
570.000	UK Treasury, 4.13%, 29/01/2027	645
90.500.000	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/10/2024	577
990.000	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2024	573
790.000	Canada Government Bond, 3.00%, 01/04/2026	530
770.000	Canada Government Bond, 3.75%, 01/05/2025	529
79.650.000	Japan Government Five Year Bond, 0.01%, 20/09/2026	508
490.000	France Government Bond OAT, 0.00%, 25/02/2025	467
72.150.000	Japan Government Two Year Bond, 0.01%, 01/08/2025	464
390.000	UK Treasury, 3.50%, 22/10/2025	437
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
17.420.000	Bundesschatzanweisungen, 2.80%, 12/06/2025	17.321
17.000.000	Bundesschatzanweisungen, 3.10%, 12/12/2025	17.023
17.000.000	Bundesschatzanweisungen, 3.10%, 18/09/2025	16.992
17.000.000	Bundesschatzanweisungen, 2.50%, 19/03/2026	16.869
17.000.000	Bundesschatzanweisungen, 2.50%, 13/03/2025	16.854
19.400.000	China Government Bond, 2.80%, 15/11/2032	2.527
14.100.000	China Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	1.815
12.860.000	China Government Bond, 1.99%, 09/04/2025	1.642
1.310.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.50%, 04/07/2027	1.466
2.214.000	Australia Government Bond, 4.75%, 21/04/2027	1.390
10.000.000	China Government Bond, 2.75%, 17/02/2032	1.308
10.000.000	China Government Bond, 2.68%, 21/05/2030	1.299
9.800.000	China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026	1.269
2.157.000	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2025	1.224
1.292.000	US Treasury, 2.25%, 15/11/2024	1.165
954.000	UK Treasury, 0.13%, 30/01/2026	1.020
1.655.000	Australia Government Bond, 0.25%, 21/11/2024	970
4.290.000	China Government Bond, 4.33%, 10/11/2061	765
5.200.000	China Government Bond, 3.32%, 15/04/2052	757
850.000	US Treasury, 3.00%, 30/06/2024	755

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK DIVERSIFYING FIXED INCOME FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
24.825	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	2.520
46.021	iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	202
698	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	150
27.961	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	138
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
24.164	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	2.457
	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse Z EUR Hedged Accumulating	1.344
12.543		
176.037	iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	801
	iShares ESG Screened Euro Corporate Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible Euro Accumulating	794
82.597		
	iShares ESG Screened Global Corporate Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse D EUR Hedged Accumulating	544
60.368		
2.314	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	519
5.235	iShares € High Yield Corp Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	490
	iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible Euro Hedged Accumulating	254
26.742		
35.122	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	180

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK EMERGING MARKETS ALPHA TILTS FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
29.063.100	US Treasury Bill, 0.00%, 16/04/2024	28.944
26.181.900	US Treasury Bill, 0.00%, 28/11/2023	26.081
24.195.900	US Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2023	24.115
24.083.700	US Treasury Bill, 0.00%, 19/03/2024	23.985
23.984.600	US Treasury Bill, 0.00%, 20/02/2024	23.886
22.299.400	US Treasury Bill, 0.00%, 23/01/2024	22.208
18.711.000	US Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023	18.656
18.146.700	US Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	18.075
17.720.300	US Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023	17.645
16.776.000	US Treasury Bill, 0.00%, 08/08/2023	16.709
14.450.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2023	14.391
13.637.400	US Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2023	13.582
10.917.600	US Treasury Bill, 0.00%, 31/10/2023	10.873
16.800	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	4.146
228.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	3.937
311.400	ANTA Sports Products Ltd.	3.607
91.528	Genpact Ltd.	3.599
63.002	Samsung Electronics Co. Ltd.	3.454
109.843	Larsen & Toubro Ltd.	3.339
31.941	PDD Holdings, Inc. ADR	3.253
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
9.830.300	US Treasury Bill, 0.00%, 28/11/2023	9.792
4.188.300	US Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2023	4.186
16.800	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	4.074
53.481	Kia Corp.	4.061
4.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2023	3.985
3.861.400	US Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	3.859
920.224	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	3.520
912.571	FirstRand Ltd.	3.419
2.390	Samsung Electronics Co. Ltd. GDR	3.346
187.732	IndusInd Bank Ltd.	3.259
296.000	Makalot Industrial Co. Ltd.	3.141
5.314.100	Bank Central Asia Tbk. PT	3.093
103.520	Anglo American plc	2.919
179.300	Baidu, Inc. 'A'	2.873
48.068	HDFC Bank Ltd. ADR	2.800
8.047.400	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT	2.793
85.570	Reliance Industries Ltd.	2.727
163.957	Infosys Ltd.	2.605
4.335.000	China Construction Bank Corp. 'H'	2.548
117.317	Kotak Mahindra Bank Ltd.	2.509

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK GLOBAL EQUITY SELECTION FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
161.767	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.211
6.526	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	1.001
20.192	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD	474
54.122	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	245
13.466	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Klasse X2 USD	161
19.662	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	154
3.060	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Klasse X2 EUR	149
8.708	BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Klasse X2 EUR	148
23.681	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	147
899	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Klasse X EUR Accumulating	133
10.037	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Anteilklasse GBP (Dist)	86
984	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Klasse X2 USD	74
5.007	BlackRock Global Funds - World Real Estate Securities Fund - Klasse X2 USD	63
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
208.606	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.206
42.333	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Klasse X2 USD	821
15.009	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Klasse X2 EUR	792
90.806	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	698
4.459	BlackRock Global Funds - Systematic Sustainable Global SmallCap Fund - Klasse D2 EUR	613
29.606	BlackRock Global Funds - European Special Situations Fund - Klasse X2 EUR	571
49.914	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Klasse X2 USD	525
2.883	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating	474
3.008	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Klasse X EUR Accumulating	453
2.615	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	423
15.617	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD	418
47.819	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	377
14.067	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Klasse X2 USD	300
1.433	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Klasse X2 EUR	258
41.468	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	203
17.842	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF - Anteilklasse GBP (Dist)	157
4.843	BlackRock Global Funds - World Energy Fund - Klasse X2 EUR	153
21.869	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	132
725	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Klasse X2 USD	102
1.195	BlackRock Global Funds - World Healthscience Fund - Klasse X2 USD	91

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
217.450	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.630
10.975	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.298
12.928	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund – Klasse X2 EUR	1.247
212.734	iShares Core UK Gilts ETF – Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	1.017
4.372	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating	697
72.204	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Klasse X2 USD Hedged	688
4.437	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Klasse X EUR Accumulating	641
3.902	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist)	637
58.500	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Klasse X2 USD	590
103.102	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	536
2.971	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	492
3.040	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	491
77.461	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	480
68.800	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Klasse X2 EUR	475
98.919	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	419
68.602	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	311
70.474	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	309
11.086	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD	255
48.342	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	230
48.917	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	160
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
513.481	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	2.582
344.592	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	1.733
289.338	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.681
9.540	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund – Klasse X2 EUR	922
16.852	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund - Klasse X2 EUR	869
5.080	BlackRock Advantage Europe Equity Fund - Klasse X EUR Accumulating	767
148.745	iShares Core UK Gilts ETF – Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	733
152.756	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	652
58.240	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Klasse X2 USD	612
3.040	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	552
3.746	BlackRock Global Funds - US Basic Value Fund - Klasse X2 USD	529
4.430	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	465
2.675	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating	451
2.744	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	423
19.960	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Klasse X2 USD	397
3.396	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	395
18.502	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Klasse X2 USD	393
33.709	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund - Klasse X2 USD	375
2.349	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist)	373
3.969	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Klasse X2 EUR	369
28.885	BlackRock Global Funds - European High Yield Bond Fund - Klasse X2 EUR	367
45.657	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	363
2.340	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Klasse X2 USD	349
44.593	iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	343
1.826	BlackRock Global Funds - United Kingdom Fund - Klasse X2 EUR	327
2.750	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund – Klasse X2 USD	322
12.239	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD	312
38.403	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Klasse X2 EUR	260
63.959	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	259

BLACKROCK MULTI ASSET BALANCED SELECTION FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Verkäufe (Fortsetzung)		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
18.655	iShares UK Index Fund (IE) - Klasse Euro (Hedged) Flexible Accumulating	224

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
732.721	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	5.456
801.935	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	3.813
39.043	BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund – Klasse X USD Accumulating	3.710
37.774	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund – Klasse X2 EUR	3.611
234.175	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund – Klasse X2 EUR	2.340
13.604	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist)	2.203
501.950	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	2.062
19.160	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	2.056
394.447	iShares Core UK Gilts ETF – Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	1.897
16.046	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	1.805
380.659	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	1.674
273.568	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	1.418
8.717	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	1.414
266.264	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	1.348
127.184	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Klasse X2 USD	1.277
226.461	iShares China CNY Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	1.192
187.767	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.164
6.995	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	1.126
238.774	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.091
8.185	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	976
143.445	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Klasse X2 EUR	964
100.319	BlackRock Global Funds - China Bond Fund - Klasse X2 USD Hedged	954
5.479	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund – Klasse X2 EUR	800
141.449	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	567
22.187	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD	522
5.416	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Klasse X2 EUR	508
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
1.427.094	iShares € Ultrashort Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	7.191
900.667	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	4.528
625.536	iShares Edge MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	3.946
30.268	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Klasse X2 EUR	3.278
384.496	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	2.985
18.647	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Klasse X2 USD	2.650
623.521	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	2.649
27.063	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Corporate Bond Fund – Klasse X2 EUR	2.630
23.444	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	2.448
20.187	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	2.378
229.623	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund – Klasse X2 EUR	2.319
15.706	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund – Klasse X2 EUR	2.242
394.447	iShares Core UK Gilts ETF – Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	1.950
17.718	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Euro Bond Fund - Klasse X2 EUR	1.683
8.717	iShares € Govt Bond 15-30yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Dist)	1.583
148.006	BlackRock Global Funds - Systematic China A-Share Opportunities Fund - Klasse X2 USD	1.553
8.338	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Dist)	1.325
12.253	BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund – Klasse X USD Accumulating	1.208
295.565	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	1.202
8.634	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.028
144.902	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Local Currency Bond Fund - Klasse X2 EUR	993
38.567	BlackRock Global Funds - World Technology Fund - Klasse X2 USD	974
73.356	BlackRock Global Funds - European High Yield Bond Fund - Klasse X2 EUR	932
61.046	BlackRock Global Funds - Global Inflation Linked Bond Fund - Klasse X2 EUR Hedged	931
191.014	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	902
180.463	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	864

BLACKROCK MULTI ASSET CONSERVATIVE SELECTION FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Verkäufe (Fortsetzung)		Erlöse
Menge	Anlagen	Tsd. EUR
6.713	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund – Klasse X2 USD	785
5.053	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	782
36.376	BlackRock Global Funds - World Financials Fund - Klasse X2 USD	761
35.666	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund - Klasse X2 USD	756

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe			Kosten
Menge	Anlagen		Tsd. USD
2.081.500	US Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023		2.075
2.004.300	US Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023		1.996
1.697.700	US Treasury Bill, 0.00%, 25/01/2024		1.647
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023		1.638
1.669.400	US Treasury Bill, 0.00%, 09/11/2023		1.633
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/09/2023		1.629
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 12/10/2023		1.620
1.600.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023		1.559
1.521.700	US Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023		1.517
211.000	China Construction Bank Corp. 'H'		141
812	NAVER Corp.		121
109.000	Compal Electronics, Inc.		91
8.800	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co. Ltd. 'A'		89
17.413	Gerdau SA, Preference ADR		87
5.145	Gold Fields Ltd. ADR		80
21.000	Quanta Computer, Inc.		79
300	Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'		75
2.151	Kolon Industries, Inc.		70
2.000	Airtac International Group		65
1.589	Genpact Ltd.		61
Verkäufe			Erlöse
Menge	Anlagen		Tsd. USD
1.697.700	US Treasury Bill, 0.00%, 25/01/2024		1.648
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023		1.642
1.669.400	US Treasury Bill, 0.00%, 09/11/2023		1.637
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/09/2023		1.633
1.650.000	US Treasury Bill, 0.00%, 12/10/2023		1.625
1.600.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023		1.563
1.521.700	US Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023		1.520
41.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.		756
13.700	Tencent Holdings Ltd.		585
8.551	Samsung Electronics Co. Ltd.		465
35.840	Alibaba Group Holding Ltd.		384
10.162	JD.com, Inc. 'A'		187
263.000	China Construction Bank Corp. 'H'		171
24.000	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'		161
248.300	Bank Central Asia Tbk. PT		152
6.000	MediaTek, Inc.		150
501	POSCO Holdings, Inc.		149
8.195	NetEase, Inc.		147
368.700	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT		134
12.000	Delta Electronics, Inc.		128

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

FR MULTI-ASSET FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
2.713.404	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	11.890
70.581	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	7.930
70.247	BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund – Klasse X USD Accumulating	6.832
	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	5.279
47.973	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund – Klasse X2 EUR	4.966
499.182	iShares Bloomberg Enhanced Roll Yield Commodity Swap UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	4.712
710.463	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	3.785
522.897	iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	2.985
460.193	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	2.652
819.092	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	2.508
595.113	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Klasse X2 EUR	2.462
175.661	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund – Klasse X2 EUR	1.965
13.546	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating	1.846
12.048	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	1.807
443.455	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	1.703
11.903	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Klasse X2 USD	1.426
12.819	iShares Green Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible EUR Hedged Accumulating	1.400
146.229	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.157
209.815	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Klasse X2 EUR	1.075
9.668	BlackRock Global Funds - European Fund - Klasse X2 EUR	640
3.054		
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
1.296.934	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	9.751
54.250	BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund - Klasse X USD Accumulating	8.923
50.485	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Real Asset Securities Fund - Klasse X2 USD	5.759
35.301	BlackRock Global Unconstrained Equity Fund - Klasse X Accumulating USD	5.421
975.445	iShares \$ TIPS UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	5.001
	BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	4.750
45.109	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Acc)	4.561
1.062.645	BlackRock Sustainable Equity Factor Plus Fund - Klasse X EUR Accumulating	4.400
39.199	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Fund - Klasse X2 USD	4.348
30.368	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Absolute Return Fund - Klasse X2 EUR	3.580
32.602	BlackRock Tactical Opportunities Fund - Klasse X EUR Hedged Accumulating	3.000
25.316	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Sustainable Fixed Income Strategies Fund - Klasse X2 EUR	2.952
20.693	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund - Klasse X2 EUR	2.950
342.101	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Fund - Klasse X2 EUR	2.900
199.061	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	2.409
10.600	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	2.406
403.195	BlackRock Global Funds - Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund – Klasse X2 EUR	2.300
226.239	BlackRock Global Funds – Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund – Klasse X2 USD	2.102
212.022	iShares \$ Corp Bond ESG UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	1.793
434.963	BlackRock Global Funds - European Fund - Klasse X2 EUR	1.700
7.315	iShares MSCI USA Value Factor ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.422
301.039	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	1.375
394.632	iShares Green Bond Index Fund (IE) - Anteilklasse Flexible EUR Hedged Accumulating	1.300
137.052	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF - Anteilklasse EUR Hedged (Dist)	1.240
285.944	BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund - Klasse X2 EUR Hedged	1.200
85.684	iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF - Anteilklasse EUR (Acc)	1.199
177.803		

FR MULTI-ASSET FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Verkäufe (Fortsetzung)		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
218.319	iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF - Anteilklasse USD (Acc)	1.052

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
42.840.000	European Union Bill, 0.00%, 04/08/2023	42.659
42.490.000	Germany Treasury Bill, 0.00%, 19/07/2023	42.377
42.040.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 19/07/2023	41.923
349.860	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	34.982
34.490.000	Belgium Treasury Bill, 0.00%, 13/07/2023	34.398
31.040.000	Dutch Treasury Certificate, 0.00%, 28/07/2023	30.972
22.400.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 03/08/2023	22.282
7.000.000	RWE AG, 2.13%, 24/05/2026	6.625
7.400.000	Enel Finance International NV, FRN, 0.00%, 28/05/2026	6.604
7.200.000	Credit Suisse AG, 1.50%, 10/04/2026	6.603
7.000.000	British Telecommunications plc, 1.75%, 10/03/2026	6.600
6.700.000	BPCE SA, 3.63%, 17/04/2026	6.592
7.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 11/05/2026	6.576
7.000.000	Wells Fargo & Co., 2.00%, 27/04/2026	6.562
6.800.000	Banco Santander SA, 3.25%, 04/04/2026	6.557
6.850.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.38%, 09/04/2026	6.533
7.000.000	Credit Mutuel Arkea SA, 1.63%, 15/04/2026	6.515
6.500.000	Westpac Banking Corp., 3.70%, 16/01/2026	6.415
7.000.000	NatWest Markets plc, 0.13%, 18/06/2026	6.182
5.800.000	A2A SpA, 2.50%, 15/06/2026	5.534
5.800.000	Citigroup, Inc., 2.13%, 10/09/2026	5.462
5.500.000	ABN AMRO Bank NV, 3.63%, 10/01/2026	5.433
5.800.000	Goldman Sachs Group, Inc. (The), 1.63%, 27/07/2026	5.409
5.700.000	National Grid North America, Inc., 0.41%, 20/01/2026	5.189
5.200.000	Sika Capital BV, 3.75%, 03/11/2026	5.158
5.000.000	Fresenius SE & Co. KGaA, 4.25%, 28/05/2026	4.971
5.300.000	Autostrade per l'Italia SpA, 1.75%, 26/06/2026	4.951
5.500.000	ASTM SpA, FRN, 1.00%, 25/11/2026	4.898

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
42.840.000	European Union Bill, 0.00%, 04/08/2023	42.750
42.490.000	Germany Treasury Bill, 0.00%, 19/07/2023	42.464
42.040.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 19/07/2023	42.014
345.191	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	34.536
31.040.000	Dutch Treasury Certificate, 0.00%, 28/07/2023	30.997
22.400.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 03/08/2023	22.356
2.000.000	Autostrade per l'Italia SpA, 1.75%, 26/06/2026	1.871
500.000	RWE AG, 2.13%, 24/05/2026	482
400.000	Svenska Handelsbanken AB, 3.75%, 05/05/2026	402
300.000	Banco Santander SA, 3.25%, 04/04/2026	297
300.000	National Grid plc, 2.18%, 30/06/2026	287
300.000	Credit Suisse AG, 1.50%, 10/04/2026	285
300.000	OP Corporate Bank plc, 0.25%, 24/03/2026	280
200.000	Commerzbank AG, 4.00%, 23/03/2026	200
200.000	BPCE SA, 3.63%, 17/04/2026	199
200.000	British Telecommunications plc, 1.75%, 10/03/2026	191
100.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.00%, 09/11/2026	101
100.000	Westpac Banking Corp., 3.70%, 16/01/2026	99
100.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.38%, 09/04/2026	96
100.000	Wells Fargo & Co., 2.00%, 27/04/2026	95

Die irische Zentralbank verlangt eine Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Portfoliozusammensetzung während des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt. Eine vollständige Aufstellung der Veränderungen im Portfolio für den Berichtszeitraum kann kostenlos beim Fondsverwalter angefordert werden.

BLACKROCK UCITS FUNDS

INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER SCHWEIZ (UNGEPRÜFT)

Die folgende Tabelle fasst die Wertentwicklung auf Kalenderjahrbasis für den Fonds zusammen, der in der Schweiz zum Angebot zugelassen ist.

Weitere Informationen über die herangezogenen Performanceindikatoren und Berechnungsmethoden sind dem Abschnitt Zusammenfassung der Wertentwicklung im Bericht des Investmentmanagers zu entnehmen. Die Währung der Klasse ist in der Erläuterung im Jahresabschluss zu dem den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettoinventarwert aufgeführt.

Name des Fonds	Auflegungsdatum	2023		2022		2021	
		Fondsrendite %	Benchmarkrendite %	Fondsrendite %	Benchmarkrendite %	Fondsrendite %	Benchmarkrendite %
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund - Klasse D Accumulating	25. Mai 2017	6,59	3,64	(6,60)	(0,32)	0,57	(0,55)
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026 – Klasse D EUR Accumulating	9. Mai 2023	4,65	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Indikator für die künftige Performance und sollte bei der Auswahl eines Produktes nicht der alleinige Entscheidungsfaktor sein. Sämtliche Finanzanlagen gehen mit einem Risiko einher. Deshalb werden der Wert Ihrer Anlage und die daraus resultierenden Erträge schwanken, und Ihr ursprünglicher Anlagebetrag kann nicht garantiert werden. Die Performance-Zahlen berücksichtigen keine Abgaben und Gebühren, die zum Zeitpunkt der Zeichnung oder Rücknahme von Anteilen erhoben werden können. Die Höhe und jeweilige Grundlage der Besteuerung können sich mitunter ändern.

BLACKROCK UCITS FUNDS

INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER SCHWEIZ (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Die TER für jede Anteilklasse ist in der folgenden Tabelle für den Zwölfmonatszeitraum zum 31. März 2024 angegeben:

Name des Fonds	Klasse des Fonds	TER (in %)
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Klasse D Accumulating	0,24
	Klasse D CHF Hedged Accumulating	0,24
	Klasse D Distributing	0,24
	Klasse Z Accumulating	0,19
	Klasse Z CHF Hedged Accumulating	0,19
	Anteilklasse Flexible Accumulating	0,03
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Klasse C CHF Hedged Accumulating	0,65
	Klasse C CHF Hedged Distributing	0,65
	Klasse C EUR Accumulating	0,65
	Klasse C EUR Distributing	0,65
	Klasse C USD Hedged Accumulating	0,65
	Klasse C USD Hedged Distributing	0,65
	Klasse D EUR Accumulating	0,30
	Klasse D EUR Distributing	0,30
	Klasse E EUR Accumulating	0,90
	Klasse E EUR Distributing	0,90

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN (UNGEPRÜFT)

Gemäß den Anforderungen der CBI hat die Verwaltungsgesellschaft sicherzustellen, dass alle zwischen den einzelnen Fonds und der Verwaltungsgesellschaft oder dem Treuhänder der Fonds, den Beauftragten oder Unterbeauftragten der Verwaltungsgesellschaft oder des Treuhänders (unter Ausschluss von einem Treuhänder ernannter Unter-Depotbanken, die keine Konzerngesellschaften sind) sowie allen angeschlossenen oder Konzerngesellschaften der Verwaltungsgesellschaft, des Treuhänders, der Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) ausgeführten Transaktionen zu marktüblichen Bedingungen und im besten Interesse der Anteilinhaber erfolgen.

Der Verwaltungsrat hat sich vergewissert, dass durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die vorstehend dargelegten Verpflichtungen bei allen Transaktionen mit verbundenen Personen eingehalten wurden, und sich ebenfalls vergewissert, dass Transaktionen mit verbundenen Personen, die im Geschäftsjahr erfolgten, diese Verpflichtung einhalten.

TRANSAKTIONSKOSTEN (UNGEPRÜFT)

Die nachstehende Tabelle enthält einzeln identifizierbare Transaktionskosten, die für den jeweiligen Fonds im Geschäftsjahr zum 31. März 2024 entstanden sind. Dazu gehören alle Maklerprovisionen, Abwicklungsgebühren, Stempelsteuern und Maklergebühren für Aktien, börsengehandelte Terminkontrakte (Futures) und bestimmte Schuldinstrumente.

Fonds	Währung	Wert Tsd.
BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1	EUR	1
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	3
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	EUR	1
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	EUR	1
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	855
BlackRock Global Equity Selection Fund	EUR	1
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	EUR	1
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	EUR	5
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	28
FR Multi-Asset Fund	EUR	26

VERRECHNUNGSPROVISIONEN (SOFT COMMISSIONS) (UNGEPRÜFT)

Im Geschäftsjahr zum 31. März 2024 wurden vom Investmentmanager im Namen der jeweiligen Fonds keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen abgeschlossen.

GESAMTRISIKOEXPOSITION (UNGEPRÜFT)

Der Verwaltungsrat ist gesetzlich zur Anwendung eines Risikomanagementprozesses verpflichtet, der es ihm ermöglicht, das globale Risiko von DFI – dem jeder Fonds aufgrund seiner Strategie ausgesetzt ist – genau zu überwachen und zu verwalten („globales Risiko“).

Der Verwaltungsrat setzt eine von zwei Methoden – „Commitment Approach“ oder „Value-at-Risk-Ansatz“ („VaR“) – zur Messung des globalen Risikos jedes Fonds und zur Steuerung potenzieller Verluste der Fonds aufgrund des Marktrisikos ein.

Commitment Approach

Der Commitment Approach ist eine Methode, die den zugrunde liegenden Markt- oder Nennwert des DFI addiert, um das globale Risiko jedes Fonds zu bestimmen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER SCHWEIZ (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Commitment-Ansatz (Fortsetzung)

Gemäß den betreffenden Vorschriften darf das globale Risiko für einen Fonds, der den Commitment Approach anwendet, 100 % des NIW des Fonds nicht überschreiten.

VaR-Ansatz

VaR ist ein statistisches Risikomaß, das den potenziellen Verlust durch nachteilige Marktbewegungen in einem gewöhnlichen Marktumfeld misst. Nähere Angaben zum VaR als Maß finden Sie in der Anmerkung zu den Finanzrisiken im Jahresabschluss.

Der Verwaltungsrat verwendet den relativen VaR zur Überwachung und Steuerung des globalen Gesamtrisikos einiger Fonds, wie unten aufgeführt. Für den relativen VaR überschreitet der VaR für das Portfolio des betreffenden Fonds nicht zwei Mal den VaR des Referenzportfolios. Für den absoluten VaR überschreitet der monatliche VaR nicht 20 % des NIW des Fonds. Wird eine VaR-Berechnung mit einem anderen Horizont als dem aufsichtsrechtlichen Einmonatslimit durchgeführt, so wird dieses Limit von 20 % neu skaliert, um die angemessene Risikohorizontperiode gemäß den jeweiligen aufsichtsrechtlichen Richtlinien widerzuspiegeln. Die Ausnutzung bezieht sich auf das in diesem Kontext eingegangene Risikoniveau.

Die nachstehende Tabelle gibt detailliert die höchste, niedrigste und durchschnittliche Ausnutzung des VaR-Limits an, ausgedrückt als Prozentsatz des jeweiligen aufsichtsrechtlichen Limits für den absoluten oder relativen VaR.

Fonds	Globaler Risiko- ansatz	Referenzportfolio	Höchste Aus- nutzung des VaR-Limits %	Niedrigste Ausnutzung des VaR- Limits %	Durch- schnittliche Ausnutzung des VaR- Limits %
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	Relativer VaR	k. A.	54,21	15,97	49,51
BlackRock Global Equity Selection Fund	Relativer VaR	ex Europe Index	55,90	37,42	51,18
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Relativer VaR	k. A.	56,50	47,96	52,59
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fonds	Absoluter VaR	k. A.	28,14	13,42	16,29

HEBELWIRKUNG (UNGEPRÜFT)

Der Einsatz von DFI kann einen Fonds erhöhten Risiken aussetzen. Insbesondere können DFI-Kontrakte hohen Schwankungen unterliegen, und der Anfangseinschuss ist in der Regel im Vergleich zum Kontraktvolumen gering, sodass die Transaktionen möglicherweise hinsichtlich des Marktrisikos mit einer Hebelwirkung (Leverage) verbunden sind. Vergleichsweise geringe Marktbewegungen können auf DFI stärkere Auswirkungen haben als auf herkömmliche Anleihen oder Aktien. Gehebelte DFI-Positionen können deshalb die Volatilität eines Fonds erhöhen.

Die nachstehende Tabelle zeigt die Höhe der Hebelwirkung, die von dem betreffenden Fonds im Geschäftsjahr zum 31. März 2024 eingesetzt wurde.

Fonds	% Durchschnittlich eingesetzte Hebelwirkung
BlackRock Developed Markets Sovereign Screened Bond Fund	245,55
BlackRock Global Equity Selection Fund	0,00
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	25,89
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	34,26

BLACKROCK UCITS FUNDS

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT)

Die nachstehenden Offenlegungen erfolgen in Bezug auf die Vergütungsrichtlinie der BlackRock Group („BlackRock“), wie sie auf die BlackRock Asset Management Ireland Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) anzuwenden ist. Die Offenlegungen erfolgen im Einklang mit der Richtlinie 2009/65/EG zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) in der aktuellen Fassung, einschließlich insbesondere der Änderungen durch Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 (die „Richtlinie“) und die „Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der OGAW-Richtlinie und der AIFMD“, die von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde herausgegeben wurden.

BlackRock's UCITS Remuneration Policy (the "UCITS Remuneration Policy") will apply to the EEA entities within the BlackRock group authorised as a manager of UCITS funds in accordance with the Directive, and will ensure compliance with the requirements of Article 14b of the Directive, and to UK entities within the BlackRock group authorised by the FCA as a manager of a UK UCITS fund.

Die Verwaltungsgesellschaft hat die OGAW-Vergütungsrichtlinie verabschiedet. Nachstehend finden Sie eine Zusammenfassung.

Vergütungssteuerung

Die Vergütungssteuerung von BlackRock in der EMEA-Region besteht aus einer mehrstufigen Struktur: (a) der Managemententwicklungs- und Vergütungsausschuss (Management Development and Compensation Committee, „MDCC“) (d. h. der globale, unabhängige Vergütungsausschuss der BlackRock, Inc.) und (b) der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft (der „Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft“). Diese Gremien sind für die Festlegung der Vergütungsrichtlinie von BlackRock, was eine regelmäßige Überprüfung der Vergütungsrichtlinie beinhaltet, und ihre Umsetzung verantwortlich.

Die Umsetzung der Vergütungsrichtlinie wird jährlich zentral und unabhängig auf die Einhaltung der vom MDCC und vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft angenommenen Vergütungsrichtlinien und -verfahren überprüft. Bei der jüngsten Überprüfung wurden keine fundamentalen Probleme festgestellt. Die Angaben zur Vergütung werden vom MDCC und dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft erstellt, die die Verantwortung dafür übernehmen.

Im Jahr 2023 wurden keine wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik vorgenommen.

(a) MDCC

Die Aufgaben des MDCC lauten wie folgt:

- Überwachung von:
 - BlackRocks Vergütungsprogrammen für leitende Angestellte,
 - BlackRocks Mitarbeiterpensionsplänen und
 - anderen Vergütungsplänen, die von BlackRock von Zeit zu Zeit eingerichtet werden, für die der MDCC als Verwalter eingesetzt wird;
- Prüfung und Erörterung der Vergütungsdiskussion und -analyse, einschließlich der jährlichen Vollmachtserklärung der BlackRock, Inc., mit der Verwaltungsgesellschaft und Genehmigung des MDCC-Berichts zur Aufnahme in die Vollmachtserklärung.
- Prüfung, Beurteilung und Erstellung von Berichten sowie Erteilung von Empfehlungen an den Verwaltungsrat der BlackRock, Inc. (der „Verwaltungsrat der BlackRock, Inc.“) nach Bedarf zur Talententwicklung und Nachfolgeplanung bei BlackRock, mit Schwerpunkt auf Performance und Nachfolge auf den höchsten Managementebenen; und
- Unterstützung der Verwaltungsräte von den der Regulierung in der EMEA-Region unterliegenden Unternehmen der Gesellschaft bei der Erfüllung ihrer vergütungsbezogenen Verpflichtungen durch Überwachung der Gestaltung und Umsetzung der EMEA-Vergütungspolitik in Übereinstimmung mit den geltenden Vorschriften.

Der MDCC verfügt direkt über seinen eigenen unabhängigen Vergütungsberater, Semler Brossy Consulting Group LLC, der keine Beziehung zur BlackRock, Inc. oder zum Verwaltungsrat der BlackRock, Inc. hat, die seine unabhängige Beratung des MDCC in Vergütungsfragen beeinträchtigen würde.

Der Verwaltungsrat der BlackRock, Inc. hat beschlossen, dass alle Mitglieder des MDCC „unabhängig“ im Sinne der Bedeutung der Börsennotierungsstandards der New York Stock Exchange (NYSE) sind, weshalb jedes einen Standard für „nicht angestellte Verwaltungsratsmitglieder“ einhalten muss.

Im Jahr 2023 hat der MDCC sieben Sitzungen abgehalten. Die Satzung des MDCC ist auf der Website von BlackRock, Inc. verfügbar (www.blackrock.com).

Auf Basis seiner regelmäßigen Prüfungen hat der MDCC die Grundsätze der Vergütungspolitik und des Vergütungsansatzes von BlackRock weiterhin für zufriedenstellend befunden.

(b) Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft hat in seiner Aufsichtsfunktion die Aufgabe, die für die Verwaltungsgesellschaft und ihre identifizierten Mitarbeiter (wie unten definiert) geltende OGAW-Vergütungspolitik zu überwachen und zu genehmigen.

Zu den Verantwortlichkeiten der Aufsichtsfunktion gehören:

- Genehmigung, Beibehaltung und Überwachung der Umsetzung der OGAW-Vergütungsrichtlinie;
- die Vergütung der Mitglieder der Leitungs/ und Führungsorgane festzulegen und zu überwachen (sofern die betreffende Verwaltungsgesellschaft keine separate Aufsichtsfunktion hat, wird die Vergütung der Mitglieder der Führungs- und Leitungsorgane vom MDCC festgelegt);
- alle späteren wesentlichen Ausnahmen oder Änderungen der OGAW-Vergütungsrichtlinie zu genehmigen und deren Auswirkungen sorgfältig zu prüfen und zu überwachen;
- die Beiträge aller zuständigen Unternehmensfunktionen (d.h. Risikomanagement, Compliance, Human Resources, strategische Planung usw.) bei der Gestaltung und Überwachung der OGAW-Vergütungsrichtlinie zu berücksichtigen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Entscheidungsfindungsprozess

Vergütungsentscheidungen für Mitarbeiter werden einmal jährlich im Januar nach Ende des Performance-Jahres getroffen. Dieser Zeitpunkt macht es möglich, dass das Finanzergebnis für das Gesamtjahr zusammen mit anderen nicht-finanziellen Zielen und Zielsetzungen in Erwägung gezogen werden kann. Obwohl das Rahmenwerk für das Treffen von Vergütungsentscheidungen mit der finanziellen Entwicklung verknüpft ist, besteht bei der Festlegung individueller variabler Vergütungen auf Grundlage des Erreichens strategischer und operativer Resultate und anderer Erwägungen, wie Geschäftsführungs- und Führungsfähigkeiten, ein signifikanter Ermessensspielraum.

Es gibt keine festen Formeln und keine festen Benchmarks für die Festlegung jährlicher Bonuszahlungen. Bei der Festlegung bestimmter, individueller Vergütungsbeträge wird eine Reihe von Faktoren berücksichtigt, darunter nicht-finanzielle Ziele und Zielsetzungen und die Finanz- und Anlageperformance insgesamt. Diese Resultate werden als Ganzes und ohne spezifische Gewichtung betrachtet. Es besteht auch keine direkte Korrelation zwischen einem bestimmten Performance-Maß und dem daraus resultierenden jährlichen Bonus. Die variable Vergütung, die eine Person (oder mehrere Personen) für ein bestimmtes Performance-Jahr erhält (erhalten), kann auch null betragen.

Jährliche Boni werden aus einem Bonuspool gezahlt.

Das Volumen des erwarteten Bonuspools, einschließlich Barauszahlungen und Aktienzuteilungen, wird im Jahresverlauf ständig vom MDCC geprüft und der endgültige Gesamt-Bonuspool nach Ende des Jahres genehmigt. Im Rahmen dieser Prüfung erhält der MDCC im Verlauf des Jahres tatsächliche und prognostizierte Finanzinformationen sowie endgültige Jahresenddaten. Die Finanzinformationen, die der MDCC erhält und in Erwägung zieht, umfassen die prognostizierte Gewinn- und Verlustrechnung für das laufende Jahr und andere Finanzkennzahlen, die mit den Vorjahresergebnissen und dem Budget für das laufende Jahr verglichen werden. Der MDCC prüft auch andere Kennzahlen der finanziellen Entwicklung von BlackRock (z. B. Nettozuflüsse zum verwalteten Vermögen und die Anlageperformance) sowie Informationen zu Marktbedingungen und Vergütungsniveaus bei Mitbewerbern.

Der MDCC berücksichtigt regelmäßig auch die Empfehlung der Geschäftsleitung für den prozentualen Anteil der auflaufenden betrieblichen Erträge vor Anreizen, der als Vergütungskosten während des Jahres für den Baranteil des gesamten jährlichen Bonuspools ausgewiesen wird (die „Steigerungsrate“). Die Steigerungsrate des Baranteils am gesamten jährlichen Bonuspool kann vom MDCC während des Jahres auf Grundlage seiner Prüfung der vorstehend beschriebenen Finanzinformationen modifiziert werden. Der MDCC wendet für die Informationen, die er bei der Ermittlung des Volumens des Gesamt-Bonuspools berücksichtigt, oder die Rückstellungen für den Baranteil des Gesamt-Bonuspools keine besonderen Gewichtungen oder Formeln an.

Nach Ende des Performance-Jahres genehmigt der MDCC den endgültigen Betrag des Bonuspools.

Im Rahmen des Prüfverfahrens am Jahresende melden die Abteilungen Enterprise Risk und Regulatory Compliance dem MDCC alle Aktivitäten, Vorfälle oder Ereignisse, die beim Treffen von Vergütungsentscheidungen berücksichtigt werden sollten.

Die einzelnen Personen sind an der Festlegung ihrer eigenen Vergütung nicht beteiligt.

Kontrollfunktionen

Jede der Kontrollfunktionen (Enterprise Risk, Legal & Compliance, Finance, Human Resources und Internal Audit) hat ihre eigene Organisationsstruktur, die von den Geschäftseinheiten unabhängig ist. Die Mitarbeiter der Kontrollfunktionen werden daher unabhängig von den von ihnen beaufsichtigten Geschäftsbereichen vergütet. Der Leiter jeder Kontrollfunktion ist entweder ein Mitglied des Global Executive Committee („GEC“) bzw. des Global Management Committee oder hat eine Berichtspflicht gegenüber dem Verwaltungsrat der BlackRock Group Limited, der Muttergesellschaft aller der Regulierung in der EMEA-Region unterliegenden Unternehmen, einschließlich der Verwaltungsgesellschaft.

Funktionale Bonuspools werden unter Bezugnahme auf die Leistung jeder einzelnen Funktion festgelegt. Die Vergütung leitender Angehöriger von Kontrollfunktionen wird direkt vom MDCC beaufsichtigt.

Verbindung zwischen Zahlung und Leistung

Es gibt eine klar und genau definierte „Bezahlung nach Leistung“-Philosophie und Vergütungsprogramme, die für das Erreichen der nachfolgend dargelegten wesentlichen Zielsetzungen ausgelegt sind:

- ausgewogene Verteilung der finanziellen Ergebnisse von BlackRock zwischen Anteilhabern und Mitarbeitern;
- Gewinnung, Halten und Motivation von Mitarbeitern, die über die Fähigkeit verfügen, signifikante Beiträge zum langfristigen Erfolg des Unternehmens zu leisten;
- Ausrichtung der Interessen leitender Angestellter auf jene der Anteilhaber durch Gewährung von Aktien der BlackRock, Inc. als signifikante Komponente der jährlichen und langfristigen Anreize;
- Kontrolle fester Kosten durch Sicherstellung, dass Vergütungskosten mit der Rentabilität schwanken;
- Verknüpfung eines signifikanten Anteils der Gesamtvergütung eines Mitarbeiters mit der finanziellen und operativen Entwicklung des Geschäfts;
- Förderung eines soliden und wirksamen Risikomanagements in allen Risikokategorien, Nachhaltigkeitsrisiken eingeschlossen;
- keine Ermutigung zur Übernahme übermäßiger Risiken (ob im Zusammenhang mit Nachhaltigkeit oder anderweitig); und
- Gewährleistung, dass die Interessen der Kunden nicht durch auf kurz-, mittel- und/oder langfristiger Basis gewährte Vergütungen beeinträchtigt werden.

BLACKROCK UCITS FUNDS

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Verbindung zwischen Zahlung und Leistung (Fortsetzung)

Eine leistungsorientierte Kultur ist von der Fähigkeit abhängig, die Leistung gegenüber Zielsetzungen, Werten und Verhaltensweisen auf klare und beständige Weise zu messen. Vorgesetzte verwenden eine Fünf-Punkte-Bewertungsskala für die Gesamtbeurteilung der Leistungen eines Mitarbeiters. Mitarbeiter bewerten sich außerdem auch selbst. Die endgültige Gesamtbewertung wird im Rahmen der Leistungsbeurteilung für jeden Mitarbeiter ermittelt. Mitarbeiter werden auf Grundlage der Art und Weise, wie die Leistung erzielt wird, und der absoluten Leistung an sich beurteilt.

Im Geiste der Philosophie „Bezahlung nach Leistung“ werden die Bewertungen dazu herangezogen, um die individuelle Leistung zu differenzieren und zu belohnen – sie bestimmen aber nicht die Vergütungsergebnisse. Vergütungsentscheidungen bleiben Ermessensentscheidungen und werden im Rahmen des Vergütungsverfahrens am Ende des Jahres getroffen.

Bei der Festlegung des Vergütungsniveaus werden neben der individuellen Leistung auch andere Faktoren in Erwägung gezogen, wie zum Beispiel:

- die Leistung der Verwaltungsgesellschaft, die Wertentwicklung der Fonds, die von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden, und/oder die Leistung der jeweiligen funktionalen Abteilung;
- Faktoren, die für den individuellen Mitarbeiter relevant sind (z. B. relevante Arbeitsregelungen einschließlich Teilzeitstatus falls zutreffend), Beziehungen mit Kunden und Kollegen, Teamwork, Fachkenntnisse, evtl. Verhaltensprobleme und, vorbehaltlich einer evtl. anzuwendenden Richtlinie, die Auswirkungen, die eine relevante Abwesenheit auf den Beitrag zum Geschäft haben könnten;
- die Steuerung des Risikos innerhalb der für BlackRock-Kunden angemessenen Risikoprofile;
- strategische Geschäftserfordernisse, einschließlich Absichten, einen Mitarbeiter zu halten;
- Marktinformationen;
- Unverzichtbarkeit für die Geschäftstätigkeit; und
- die Unterstützung der Ansätze des Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren sowie Vielfalt, Gerechtigkeit und Inklusion.

Ein Risikomanagement ist ein vorrangiges Produktwerkzeug und obwohl Mitarbeiter für eine starke Wertentwicklung bei der Verwaltung von Kundenvermögen vergütet werden, müssen sie das Risiko innerhalb der für ihre Kunden angemessenen Risikoprofile steuern. Mitarbeiter werden daher nicht für die Tätigkeit von Transaktionen mit hohem Risiko außerhalb der festgelegten Parameter belohnt. Die Vergütungspraktiken bieten keine unangebrachten Anreize für kurzfristige Planungen und keine kurzfristigen finanziellen Belohnungen, sie belohnen unangemessenes Risiko nicht und sie bieten ein angemessenes Gleichgewicht zwischen den vielen und erheblichen Risiken, die mit dem Geschäft der Anlageverwaltung, dem Risikomanagement und Beratungsdienstleistungen einhergehen.

BlackRock unterhält ein Gesamtvergütungsmodell, das ein vertraglich festgelegtes Grundgehalt sowie ein Bonussystem auf Ermessensbasis umfasst.

BlackRock unterhält ein jährliches Bonussystem auf Ermessensbasis. Obwohl alle Mitarbeiter Anspruch darauf haben, für einen Bonus auf Ermessensbasis in Erwägung gezogen zu werden, besteht keine vertragliche Verpflichtung im Rahmen eines Bonussystems auf Ermessensbasis zur Zahlung einer Prämie an einen Mitarbeiter. Bei Nutzung des Ermessensspielraums zur Zahlung eines Bonus auf Ermessensbasis können, zusätzlich zu anderen Angelegenheiten, die für die Wahrnehmung des Ermessensspielraums im Laufe des Performance-Jahres von Relevanz sind, die vorstehend (unter der Überschrift „Verbindung zwischen Zahlung und Leistung“) aufgeführten Faktoren in Betracht gezogen werden.

Bonuszahlungen auf Ermessensbasis für alle Mitarbeiter, einschließlich Vorstandsangehörigen, unterliegen einer Richtlinie, die den Anteil, der in bar ausgezahlt wird, und den Teil, der in Aktien der BlackRock, Inc. gewährt wird, festlegt, und erfolgen vorbehaltlich zusätzlicher Erdienungs-/Rückforderungsbedingungen. Aktienzuteilungen unterliegen dem Vorbehalt weiterer Performance-Anpassungen durch Veränderungen des Aktienkurses von BlackRock, Inc. über den Erdienungszeitraum. Mit steigender jährlicher Gesamtvergütung wird ein größerer Anteil als aufgeschobene Zahlung in Form von Aktien geleistet. Der MDCC übernahm diesen Ansatz 2006, um den Anbindungswert deutlich zu erhöhen und die Ausrichtung des Vergütungspakets für anspruchsberechtigte Mitarbeiter, einschließlich der Vorstandsangehörigen, zu verbessern. Der Anteil, der als aufgeschobene Zahlung in Form von Aktien zugeteilt wird, wird in drei gleichen Raten über die drei Jahre nach der Gewährung erdient.

Zusätzlich zu dem jährlichen Bonus auf Ermessensbasis, wie vorstehend beschrieben, können bestimmten Mitarbeiter Aktienzuteilungen gewährt werden, um eine stärkere Verknüpfung mit den zukünftigen Geschäftsergebnissen herzustellen. Diese langfristigen Anreize wurden individuell festgelegt, um sinnvolle Anreize für die fortwährende Leistung über einen Zeitraum von mehreren Jahren hinweg zu schaffen, die den Umfang der Rolle der Person, ihrer Geschäftserfahrung und Führungsfähigkeit anerkennen.

Ausgewählte Mitarbeiter in Führungspositionen haben Anspruch auf den Erhalt leistungsadjustierter Prämien auf Eigenkapitalbasis (Aktienzuteilung) aus dem „BlackRock Performance Incentive Plan“ („BPIP“). Prämien, die aus dem BPIP gezahlt werden, verfügen über einen dreijährigen Performance-Zeitraum auf Grundlage der Kennzahlen „As Adjusted Operating Margin“¹ und „Organic Revenue Growth“². Die Ermittlung der Auszahlung erfolgt auf Grundlage der Leistungen des Unternehmens gegenüber Vorgaben für die Finanzergebnisse bei Abschluss des Performance-Zeitraums. Die Höchstzahl der Aktien, die verdient werden können, beträgt 165 % der Prämie in Situationen, in denen beide Kennzahlen die vorgegebenen Finanzziele erreichen. Es werden keine Aktien verdient, wenn die finanzielle Performance des Unternehmens bei beiden vorgenannten Kennzahlen unter einer vorgegebenen Performance-Schwelle liegt. Diese Kennzahlen wurden als wesentliche Kennzahlen für den sogenannten Shareholder Value über Marktzyklen hinweg gewählt.

Eine begrenzte Zahl von Anlageexperten erhält einen Teil des jährlichen Bonus auf Ermessensbasis (wie vorstehend beschrieben) in Form von aufgeschobenen Barmitteln, die nominal die Anlage in ausgewählten Produkten, die von dem Mitarbeiter verwaltet werden, nachbilden. Absicht dieser Prämien ist es, die Anlageexperten über den Aufschub der Vergütung in diese Produkte auf die Anlageerträge der Produkte, die sie verwalten, zu fokussieren. Kunden und externe Gutachter sehen Produkte, bei denen wichtige Anleger aufgrund signifikanter persönlicher Investitionen „etwas zu verlieren“ haben, zunehmend in positiverem Licht.

¹As Adjusted Operating Margin: Bezeichnet in der externen Berichterstattung von BlackRock die bereinigten betrieblichen Erträge dividiert durch den Gesamtertrag abzüglich Vertriebs- und Verwaltungskosten und Abschreibung aufgeschobener Vertriebsprovisionen.

²Organic Revenue Growth: Entspricht der neuen Netto-Grundgebühr zzgl. neuer Aladdin-Erträge, die während des Jahres generiert wurden (in US-Dollar).

BLACKROCK UCITS FUNDS

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Identifizierte Mitarbeiter

Die OGAW-Vergütungsrichtlinie legt das Verfahren fest, das zur Identifikation von Mitarbeitern als identifizierte Mitarbeiter angewendet wird. Dabei handelt es sich um Mitarbeiter-Kategorien der Verwaltungsgesellschaft, einschließlich der Geschäftsleitung, Risikoträger, Kontrollfunktionen und Mitarbeiter, die eine Gesamtvergütung erhalten, die sie in die gleiche Vergütungsklasse wie die Geschäftsleitung und Risikoträger bringt, deren berufliche Tätigkeit sich wesentlich auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder der Fonds, die sie verwaltet, auswirkt.

Die Liste der identifizierten Mitarbeiter unterliegt regelmäßigen Überprüfungen, die insbesondere in den folgenden Fällen durchgeführt werden:

- organisatorische Änderungen;
- neue Geschäftsinitiativen;
- Veränderungen in den Listen signifikanter Einflussfunktionen;
- Veränderungen der Rollen-Verantwortlichkeiten und
- revidierte aufsichtsrechtliche Richtung.

BlackRock wendet im Fall von Mitarbeitern, die als „identifizierte Mitarbeiter“ bezeichnet werden den Grundsatz der Verhältnismäßigkeit an. BlackRock stützt Grundsatz der Verhältnismäßigkeit auf eine Kombination von Faktoren, die es auf der Grundlage der entsprechenden Leitlinien zu berücksichtigen berechtigt ist. Die Anwendung des Grundsatzes der Verhältnismäßigkeit wurde anhand der in den ESMA-Leitlinien festgelegten Kriterien bewertet, d. h. Kriterien in Bezug auf Größe, die interne Organisation sowie die Art, der Umfang und die Komplexität der Tätigkeiten, die Personengruppe, die nur als Einheit einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft hat, und Struktur der Vergütung der identifizierten Mitarbeiter.

Quantitative Angaben zur Vergütung

Die Verwaltungsgesellschaft ist gemäß der Richtlinie verpflichtet, quantitative Angaben zur Vergütung zu machen. Diese Angaben werden gemäß Auslegung von BlackRock bezüglich der aktuell verfügbaren aufsichtsrechtlichen Vorgaben zu quantitativen Vergütungsangaben gemacht. Je nachdem, wie sich die Markt- oder aufsichtsrechtliche Praxis weiterentwickelt, kann BlackRock es für sinnvoll erachten, die Art und Weise, wie quantitative Angaben zur Vergütung berechnet werden, zu ändern. Wenn solche Änderungen vorgenommen werden, kann dies dazu führen, dass Angaben zu einem Fonds nicht vergleichbar mit den Angaben des Vorjahres oder mit Angaben zu einem anderen Fonds von BlackRock im selben Jahr sind.

Vergütungsinformationen auf Ebene der einzelnen Fonds sind nicht ohne weiteres verfügbar. Angaben werden gemacht in Bezug auf (a) die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft; (b) Mitarbeiter, die der Geschäftsleitung angehören; (c) Mitarbeiter mit der Fähigkeit, das Risikoprofil des Fonds wesentlich zu beeinflussen; und (d) Mitarbeiter von Unternehmen, an die das Portfoliomanagement und das Risikomanagement formell delegiert wurden.

Alle in die offengelegten Gesamtzahlen einbezogenen Personen werden gemäß der Vergütungspolitik von BlackRock für ihre Aufgaben im jeweiligen Geschäftsbereich von BlackRock vergütet. Da alle Personen mehrere Aufgabenbereiche haben, wird nur der Teil der Vergütung für die Leistungen dieser Personen in die offen gelegten Gesamtzahlen einbezogen, der der Verwaltungsgesellschaft zuzurechnen ist.

Mitarbeiter und Mitglieder der Geschäftsleitung der Verwaltungsgesellschaft erbringen in der Regel auf OGAW und Nicht-OGAW bezogene Leistungen für mehrere Fonds, Kunden und Funktionen der Verwaltungsgesellschaft sowie innerhalb der BlackRock Gruppe insgesamt. Umgekehrt können Mitarbeiter und Mitglieder der Geschäftsleitung der breiteren BlackRock-Gruppe in der Regel auf OGAW und Nicht-OGAW bezogene Leistungen für mehrere Fonds, Kunden und Funktionen der Verwaltungsgesellschaft sowie innerhalb der BlackRock Gruppe insgesamt, erbringen. Daher stellen die offen gelegten Zahlen eine Summe des Vergütungsanteils der betreffenden Person dar, der der Verwaltungsgesellschaft zuzurechnen ist, berechnet anhand einer objektiven Zuordnungsmethode, die dem vielfältigen Dienstleistungsspektrum der Verwaltungsgesellschaft und der breiteren BlackRock-Gruppe gerecht wird. Dementsprechend sind diese Zahlen nicht repräsentativ für die tatsächliche Vergütung einer Person oder für deren Vergütungsstruktur.

Der Gesamtbetrag der von der Verwaltungsgesellschaft ihren Mitarbeitern gewährten Vergütung für das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft zum 31. Dezember 2023 beläuft sich auf 224,73 Mio. USD. Diese Zahl setzt sich aus einer festen Vergütung von 123,02 Mio. USD und einer variablen Vergütung von 101,71 Mio. USD zusammen. Die vorstehend beschriebene Vergütung wurde an insgesamt 3.870 Empfänger gezahlt.

Die von der Verwaltungsgesellschaft für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft gezahlte Gesamtvergütung betrug 15,47 Mio. USD an ihre Mitglieder der Geschäftsleitung und 30,31 Mio. USD an andere Mitarbeiter, deren Tätigkeit potenziell wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft oder ihrer Fonds haben kann.

BLACKROCK UCITS FUNDS

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT)

Techniken des effizienten Portfoliomanagements

Der Verwaltungsrat kann, im Namen jedes Fonds und unter Einhaltung der von der Central Bank of Ireland (CBI) und im Prospekt dargelegten Bedingungen und Grenzen, Techniken und Instrumente in Bezug auf übertragbare Wertpapiere, einschließlich Anlagen in OTC-DFI, einsetzen, sofern diese Techniken und Instrumente für die Optimierung des Portfoliomanagements oder die Absicherung von Währungsrisiken oder für Direktanlagen genutzt werden.

Das zugrunde liegende Risiko, das durch DFI und die Identität der Kontrahenten dieser DFI am Ende des Geschäftsjahres eingegangen wurde, wird in der Aufstellung der Vermögenswerte des jeweiligen Fonds angegeben.

Wertpapierleihe

Alle Wertpapierleihgeschäfte, die von den Fonds eingegangen werden, unterliegen einer schriftlichen Vereinbarung zwischen dem jeweiligen Fonds und dem Vermittler für Wertpapierleihen, BlackRock Advisors (UK) Limited, einer mit dem Unternehmen verbundenen Partei, und getrennt zwischen dem Vermittler für Wertpapierleihen und dem genehmigten Entleiher. Sicherheiten, die im Austausch für verliehene Wertpapiere erhalten wurden, werden gemäß einem Titelabtretungsvertrag übertragen. Erhaltene Sicherheiten werden an ein Konto im Namen des Treuhänders im Auftrag des jeweiligen Fonds geliefert und dort gehalten. Die geleisteten Sicherheiten werden von den Vermögenswerten getrennt, die dem Treuhänder des jeweiligen Fonds oder dem Vermittler für Wertpapierleihen gehören.

Die nachstehende Tabelle gibt den Wert der verliehenen Wertpapiere im Verhältnis zu den gesamten verleihbaren Vermögenswerten des jeweiligen Fonds und als Anteil des NIW des Fonds zum 31. März 2024 sowie die erzielten Erträge/Renditen für den Zeitraum bis zum 31. März 2024 an. Die Summe aller verleihbaren Vermögenswerte ist der Gesamtwert der Vermögenswerte, die Teil des Wertpapierleihprogramms eines Fonds sind. Davon ausgeschlossen sind vom Fonds gehaltene Vermögenswerte, die aufgrund marktbezogener, aufsichtsrechtlicher, anlagebedingter oder sonstiger Einschränkungen nicht als verleihbar angesehen werden.

		% der verleihbaren Vermögenswerte	% des NIW
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	EUR	12,40	12,36
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	EUR	31,45	13,52
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	2,10	0,96
BlackRock Global Equity Selection Fund	EUR	3,06	1,01
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	EUR	5,55	1,80
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	EUR	8,04	3,68
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	EUR	0,52	0,40

Die im Geschäftsjahr von den Fonds durch Wertpapierleihgeschäfte erzielten Erträge werden in den Anmerkungen im Jahresabschluss des Fonds aufgeführt.

Alle während des Geschäftsjahres aus der Wertpapierleihe erzielten Erträge abzüglich der Gebühren des Vermittlers für Wertpapierleihen werden an den jeweiligen Fonds gezahlt (siehe auch Anmerkung zu den betrieblichen Erträgen). Wenn Einnahmen aus der Wertpapierleihe erzielt werden, erhält der Vermittler für Wertpapierleihen eine Gebühr in Höhe von 37,5 % dieser Einnahmen und zahlt alle betrieblichen und administrativen Kosten Dritter, die mit dieser Tätigkeit im Zusammenhang stehen und in diesem Zusammenhang anfallen, aus seiner Gebühr. Soweit die an Dritte zu zahlenden Kosten für die Wertpapierleihe die von dem Vermittler für Wertpapierleihen erhaltene Gebühr übersteigen, wird der Vermittler für die Wertpapierleihen die überschüssigen Beträge aus seinem eigenen Vermögen begleichen.

Die nachstehende Tabelle gibt den Wert der (in der Aufstellung der Vermögenswerte des jeweiligen Fonds einzeln aufgeführten) verliehenen Wertpapiere, aufgeschlüsselt nach Kontrahenten, zum 31. März 2024 an.

Kontrahent	Gründungsland des Kontrahenten	Wert der verliehenen Wertpapiere	Wert der erhaltenen Sicherheiten
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund		Tsd. EUR	Tsd. EUR
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	2.259	2.404
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	2.175	2.367
Barclays Bank plc	Vereinigtes Königreich	1.440	1.538
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	1.202	1.345
Deutsche Bank AG	Deutschland	924	1.016
Morgan Stanley & Co. International	Vereinigtes Königreich	633	666
UBS AG	Schweiz	295	316
Citigroup Global Markets Ltd.	Vereinigtes Königreich	110	120
BNP Paribas	Frankreich	96	101
Gesamt		9.134	9.873
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund		Tsd. EUR	Tsd. EUR
BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	8.931	10.921
Gesamt		8.931	10.921
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund		Tsd. USD	Tsd. USD
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	1.693	1.806
UBS AG	Schweiz	913	1.034
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	8	10
Gesamt		2.614	2.850
BlackRock Global Equity Selection Fund		Tsd. EUR	Tsd. EUR
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	309	375
Gesamt		309	375

BLACKROCK UCITS FUNDS

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Wertpapierleihe (Fortsetzung)

Kontrahent	Gründungsland des Kontrahenten	Wert der verliehenen Wertpapiere Tsd. EUR	Wert der erhaltenen Sicherheiten Tsd. EUR
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund			
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	406	493
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	94	101
Citigroup Global Markets Ltd.	Vereinigtes Königreich	62	71
Gesamt		562	665
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund			
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	2.895	3.124
Gesamt		2.895	3.124
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026			
BNP Paribas	Frankreich	902	937
Gesamt		902	937

Alle verliehenen Wertpapiere haben ein offenes Fälligkeitsprofil, da sie täglich abruf- oder kündbar sind.

Total Return Swaps

Sämtliche Total Return Swaps werden vom jeweiligen Fonds gemäß einem ISDA-Rahmenvertrag oder einer ähnlichen Vereinbarung abgeschlossen. Ein ISDA-Rahmenvertrag ist eine bilaterale Vereinbarung zwischen dem Fonds und einem Kontrahenten, der die von den Parteien abgeschlossenen OTC-DFI (einschließlich von Total Return Swaps) regelt. Das Engagement der Parteien gemäß dem ISDA-Rahmenvertrag wird verrechnet und zusammen besichert. Daher beziehen sich jedwede Offenlegungen zu Sicherheiten auf alle OTC-DFI, die ein Fonds gemäß dem ISDA-Rahmenvertrag abgeschlossen hat, und nicht nur auf Total Return Swaps.

Alle Sicherheiten, die die einzelnen Fonds laut dem ISDA-Rahmenvertrag erhalten/leisten, werden bilateral gemäß einem Titelabtretungsvertrag übertragen.

Die nachstehende Tabelle enthält Angaben zum Wert der Total Return Swaps als prozentualer Anteil des NIW des Fonds zum 31. März 2024 und zu den laufenden Erträgen/Renditen im Geschäftsjahr zum 31. März 2024. Der Wert der Total Return Swaps basiert auf dem zugrunde liegenden Positionswert auf absoluter Bruttobasis.

		% des NIW	Erzielte Gesamterrenditen Tsd.
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	10,86	1.052
BlackRock Systematic ESG Emerging Markets Equity Fund	USD	–	93

Die aus Total Return Swaps erzielten Gesamterrenditen werden auf Gesamtertragsbasis ausgewiesen, einschließlich entsprechender Zins- und Dividendenerträge bzw. -aufwendungen sowie Nettogewinne/(-verluste) aus Bewegungen des beizulegenden Zeitwerts. Alle Renditen und Kosten aus Total Return Swaps werden dem jeweiligen Fonds zugerechnet und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Gewinnen oder Kosten mit der Verwaltungsgesellschaft des Fonds oder anderen Dritten.

Die folgende Tabelle zeigt den zugrunde liegenden Positionswert für Total Return Swaps, analysiert nach Kontrahenten zum 31. März 2024.

Kontrahent	Gründungsland des Kontrahenten	Basisengagement Tsd. USD
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund		
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	11.068
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	9.819
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	8.646

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse des Fälligkeitsprofils der Total Return Swaps zum 31. März 2024.

Fonds	Währung	Fälligkeitsprofil	
		Mehr als 365 Tage Tsd.	Gesamt Tsd.
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	USD	29.533	29.533

Die obige Analyse der Fälligkeitsprofile basiert auf dem entsprechenden vertraglichen Fälligkeitstermin.

BLACKROCK UCITS FUNDS

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Analyse der Sicherheitenwährung

Die nachstehende Tabelle zeigt eine Analyse nach Währung der Bar- und Sachsicherheiten, die jeder Fonds zum 31. März 2024 in Form einer Vollrechtsübertragung in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte und OTC-DFI erhalten/hinterlegt hat.

Währung	Geleistete Bar- sicherheiten	Erhaltene Sach- sicherheiten
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Wertpapierleihgeschäfte		
AUD	–	260
CAD	–	72
DKK	–	1
EUR	–	4.206
GBP	–	2.242
USD	–	3.092
Gesamt	–	9.873
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Wertpapierleihgeschäfte		
EUR	–	2.778
GBP	–	7.051
USD	–	1.092
Gesamt	–	10.921
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Tsd. USD	Tsd. USD
Wertpapierleihgeschäfte		
AUD	–	37
EUR	–	3
GBP	–	157
JPY	–	23
SEK	–	1
USD	–	2.629
OTC-DFI		
USD	821	–
Gesamt	821	2.850
BlackRock Global Equity Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Wertpapierleihgeschäfte		
AUD	–	5
DKK	–	7
EUR	–	48
GBP	–	96
SEK	–	29
USD	–	190
Gesamt	–	375
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Wertpapierleihgeschäfte		
AUD	–	6
DKK	–	10
EUR	–	76
GBP	–	167
JPY	–	11
SEK	–	49
USD	–	346
Gesamt	–	665
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Wertpapierleihgeschäfte		
EUR	–	3
GBP	–	167
USD	–	2.954
Gesamt	–	3.124
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Wertpapierleihgeschäfte		
CAD	–	118
EUR	–	817
GBP	–	1
USD	–	1
Gesamt	–	937

BLACKROCK UCITS FUNDS

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Analyse der Art, Qualität und Fälligkeit der Sicherheit

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse der Art, Qualität und Fälligkeit der von den einzelnen Fonds über einen Titelabtretungsvertrag in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte erhaltenen Sachsicherheiten zum 31. März 2024.

Art und Qualität der Sicherheit	Fälligkeitsprofil							Gesamt
	1 Tag	2 - 7 Tage	8 - 30 Tage	31 - 90 Tage	91 - 365 Tage	Mehr als 365 Tage	Unbefristet	
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten - Wertpapierleihe								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	34	–	59	1.055	7.109	–	8.257
Aktien								
Anerkannter Aktienindex	–	–	–	–	–	–	1.589	1.589
ETFs								
OGAW	–	–	–	–	–	–	27	27
Gesamt	–	34	–	59	1.055	7.109	1.616	9.873
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten - Wertpapierleihe								
Aktien								
Anerkannter Aktienindex	–	–	–	–	–	–	10.921	10.921
Gesamt	–	–	–	–	–	–	10.921	10.921
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Erhaltene Sicherheiten - Wertpapierleihe								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	–	–	491	877	–	1.368
Aktien								
Anerkannter Aktienindex	–	–	–	–	–	–	1.383	1.383
ETFs								
OGAW	–	–	–	–	–	–	99	99
Gesamt	–	–	–	–	491	877	1.482	2.850
BlackRock Global Equity Selection Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten - Wertpapierleihe								
Aktien								
Anerkannter Aktienindex	–	–	–	–	–	–	375	375
Gesamt	–	–	–	–	–	–	375	375

BLACKROCK UCITS FUNDS

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Analyse der Art, Qualität und Fälligkeit der Sicherheit (Fortsetzung)

Art und Qualität der Sicherheit	Fälligkeitsprofil							Gesamt
	1 Tag	2 - 7 Tage	8 - 30 Tage	31 - 90 Tage	91 - 365 Tage	Mehr als 365 Tage	Unbefristet	
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund								
Erhaltene Sicherheiten - Wertpapierleihe								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	–	–	28	49	–	77
Aktien								
Anerkannter Aktienindex	–	–	–	–	–	–	582	582
ETFs								
OGAW	–	–	–	–	–	–	6	6
Gesamt	–	–	–	–	28	49	588	665
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund								
Erhaltene Sicherheiten - Wertpapierleihe								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	–	–	850	1.516	–	2.366
Aktien								
Anerkannter Aktienindex	–	–	–	–	–	–	588	588
ETFs								
OGAW	–	–	–	–	–	–	170	170
Gesamt	–	–	–	–	850	1.516	758	3.124
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026								
Erhaltene Sicherheiten - Wertpapierleihe								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	–	–	200	737	–	937
Gesamt	–	–	–	–	200	737	–	937

Investment-Grade-Wertpapiere sind Wertpapiere, die von einem Unternehmen begeben wurden und ein Mindest-Kreditrating von mindestens einer weltweit anerkannten Ratingagentur wie Standard & Poor's, Moody's oder Fitch vorweisen können.

Ein anerkannter Aktienindex enthält mindestens 20 Aktien, von denen keine einzige Aktie mehr als 20 % des Gesamtindex ausmacht und keine fünf Aktien zusammen mehr als 60 % des Gesamtindex ausmachen.

Die Analyse der Fälligkeitsprofile von festverzinslichen Wertpapieren, die als Sicherheit erhalten/hinterlegt werden, basiert auf dem entsprechenden vertraglichen Fälligkeitstermin, wohingegen Aktien und ETFs, die als Sicherheit erhalten oder geleistet werden, als offene Transaktionen dargestellt werden, da sie keinem vertraglichen Fälligkeitstermin unterliegen.

Alle als Sicherheiten erhaltenen oder geleisteten Barmittel haben ein offenes Fälligkeitsprofil und keinen vertraglichen Fälligkeitstermin.

Weiterverwendung der erhaltenen Sicherheiten

Erhaltene Sachsicherheiten, die über einen Titelabtretungsvertrag in Bezug auf Wertpapierleihen und OTC-DFI erhalten wurden, können nicht verkauft, reinvestiert oder verpfändet werden.

BLACKROCK UCITS FUNDS

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Die nachstehende Tabelle stellt eine Analyse der Beträge der von den einzelnen Fonds in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte erhaltenen Sachsicherheiten dar, die der Treuhänder des Fonds (oder dessen Beauftragte) zum 31. März 2024 hält oder die in einem Wertpapierabrechnungssystem gehalten werden.

Depotbank	Erhaltene Sachsicherheiten Wertpapierleihe
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Tsd. EUR
Euroclear	5.971
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	3.902
Gesamt	9.873
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Tsd. EUR
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	10.921
Gesamt	10.921
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Tsd. USD
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	2.850
Gesamt	2.850
BlackRock Global Equity Selection Fund	Tsd. EUR
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	375
Gesamt	375
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Tsd. EUR
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	665
Gesamt	665
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Tsd. EUR
J.P. Morgan SE - Dublin Branch	3.124
Gesamt	3.124
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Tsd. EUR
Euroclear	937
Gesamt	937

Konzentration der erhaltenen Sicherheiten

Die nachstehende Tabelle führt die zehn größten Emittenten nach Wert der vom jeweiligen Fonds über einen Titelabtretungsvertrag erhaltenen Sachsicherheiten für alle Wertpapierleihgeschäfte zum 31. März 2024 auf.

Emittent	Wert
BlackRock Defensive Yield ESG Screened Fund	Tsd. EUR
US Treasury	1.825
France Government	1.797
UK Treasury	1.461
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	613
Ireland Government	391
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	379
Spain Government	309
Australia Government	260
Kingdom Of Belgium Government	245
Bundesobligation	228
Sonstige Emittenten	2.365
Gesamt	9.873
BlackRock Diversifying Fixed Income Fund	Tsd. EUR
Intesa Sanpaolo SpA	1.093
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	1.092
Eni SpA	1.092
Enel SpA	1.092
Stellantis NV	1.092
Iberdrola SA	1.069
Repsol SA	936
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	880
Assicurazioni Generali SpA	845
Industria de Diseno Textil SA	806
Sonstige Emittenten	924
Gesamt	10.921

BLACKROCK UCITS FUNDS

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Konzentration der erhaltenen Sicherheiten (Fortsetzung)

Emittent	Wert
BlackRock Emerging Markets Alpha Tilts Fund	Tsd. USD
US Treasury	1.366
Vale SA	170
PDD Holdings Inc	170
Elevance Health Inc	98
NetApp Inc	98
Snowflake Inc	98
Zscaler Inc	98
DoorDash Inc	97
Westinghouse Air Brake Technologies Corp	95
Vanguard FTSE 100 UCITS ETF	94
Sonstige Emittenten	466
Gesamt	2.850
BlackRock Global Equity Selection Fund	Tsd. EUR
Microsoft Corp	38
Novartis AG	25
NRG Energy Inc	14
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	12
Gitlab Inc	11
Nibe Industrier AB	11
Trade Desk Inc/The	11
Medpace Holdings Inc	10
American Water Works Co Inc	9
Imperial Brands PLC	9
Sonstige Emittenten	225
Gesamt	375
BlackRock Multi Asset Balanced Selection Fund	Tsd. EUR
US Treasury	77
Microsoft Corp	56
Novartis AG	32
NRG Energy Inc	18
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	16
Gitlab Inc	15
Nibe Industrier AB	15
Trade Desk Inc/The	14
Medpace Holdings Inc	13
American Water Works Co Inc	12
Sonstige Emittenten	397
Gesamt	665
BlackRock Multi Asset Conservative Selection Fund	Tsd. EUR
US Treasury	2.363
Vale SA	294
PDD Holdings Inc	293
Vanguard FTSE 100 UCITS ETF	163
iShares EURO STOXX Mid UCITS ETF	5
UBS Irl ETF plc - S&P 500 ESG UCITS ETF	3
Kommunalbanken AS	2
Asian Development Bank	1
Gesamt	3.124
BlackRock Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026	Tsd. EUR
Spain Government	806
Canada Government	119
German Treasury	8
Ireland Government	2
Export Development Canada	1
UK Treasury	1
Gesamt	937

Die Wertpapiersicherheiten, die in Bezug auf ein effizientes Portfoliomanagement und OTC-DFI von einem einzelnen Emittenten vereinnahmt wurden, überstiegen zum Ende des Geschäftsjahres nicht 20 % des NIW des entsprechenden Fonds .

Keiner der Fonds wurde zum Ende des Geschäftsjahres vollständig mit Wertpapieren besichert, die von einem EU-Mitgliedstaat begeben oder garantiert wurden.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT)

Glossar und Schlüsseldefinitionen

Die nachstehenden Angaben im regelmäßigen Bericht beziehen sich auf das Jahr bis zum 31. März 2024 (der „Bezugszeitraum“). Die Vergleichsinformationen werden für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023, den „vorherigen Bezugszeitraum“, vorgelegt.

Alle für die Anlagen des Fonds dargestellten Daten und andere angegebenen quantitativen Kennzahlen wurden auf der Grundlage eines Durchschnitts des Werts der gehandelten Anlagen zu jedem Quartalsende im Bezugszeitraum angegeben, für den der Fonds die Kriterien eines Artikel-8-Fonds erfüllt. Bei den Kennzahlen, die mit Nachhaltigkeitsindikatoren dargestellt werden, bezieht sich die entsprechende Kennzahlenberechnung auf die Anlagen, für die zugrunde liegende ESG-Daten verfügbar sind, und nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen.

Alle diese Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft.

Der Begriff „Vermögenswerte“ bezeichnet den Gesamtwert der vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Anlagen. Der Gesamtwert der Anlagen umfasst auch Short-Positionen auf Nettobasis (einschließlich der durch Derivate erzielten Netto-Short-Positionen). BlackRock hat bei der Berechnung der Taxonomie-Ausrichtung seiner Fonds einen angemessenen Ansatz gewählt, indem sämtliche durch Derivate erzielte Engagements ausgeschlossen werden (einschließlich Long- und Short-Positionen), d. h. durch die Berechnung des Abdeckungsgrades, in dem die Investitionen eines Fonds in Wirtschaftstätigkeiten investiert sind, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.

Die Anlagen umfassen Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente gemäß Artikel 53 der technischen Regulierungsstandards im Rahmen der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288. FRS 102 schreibt allerdings vor, dass Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente separat behandelt werden müssen. Es wird daher einen Unterschied in der Darstellung für die Zwecke des Jahresberichts in seiner Gesamtheit geben. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente werden auf Grundlage des Abrechnungstermins ausgewiesen.

Nachhaltige Investitionen BlackRock definiert nachhaltige Investitionen als Anlagen in Emittenten oder Wertpapiere, die zu einem ökologischen oder sozialen Ziel beitragen, keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und bei denen die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. BlackRock bezieht sich auf einschlägige Nachhaltigkeitsrahmenwerke, um die Ausrichtung der Investitionen auf ökologische oder soziale Ziele zu ermitteln.

Nicht erheblich beeinträchtigen („DNSH“): Die von BlackRock durchgeführte Bewertung, um festzustellen, ob eine Investition kein ökologisches oder soziales Ziel gemäß SFDR erheblich beeinträchtigt. BlackRock hat eine Reihe von Kriterien für alle nachhaltigen Investitionen entwickelt, um zu beurteilen, ob eine Investition zu einer erheblichen Beeinträchtigung führt, wobei sowohl Daten von Dritten als auch fundamentale Einsichten berücksichtigt werden. Die Investitionen werden anhand dieser Kriterien mit Hilfe von systembasierten Kontrollen überprüft, und Investitionen, die als eine erhebliche Beeinträchtigung eingestuft werden, gelten nicht als nachhaltige Anlagen.

Nachhaltigkeitsfaktoren: Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte sowie die Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Haftungsausschlüsse

Bestimmte der nachstehend aufgeführten Informationen (die „Informationen“) wurden BlackRock von Anbietern von Marktdaten zur Verfügung gestellt (von denen einige registrierte Anlageberater gemäß dem Investment Advisers Act von 1940 sein können, jeweils ein „Informationsanbieter“) und dürfen ohne vorherige schriftliche Genehmigung des jeweiligen Informationsanbieters weder ganz noch teilweise vervielfältigt oder verbreitet werden. Die Informationen wurden der US-Börsenaufsichtsbehörde SEC oder einer anderen Aufsichtsbehörde weder vorgelegt noch von ihr genehmigt. Die Informationen dürfen nicht zur Erstellung abgeleiteter Werke oder in Verbindung mit einem Kauf- oder Verkaufsangebot oder einer Werbung oder Empfehlung für ein Wertpapier, ein Finanzinstrument oder ein Produkt oder eine Handelsstrategie verwendet werden. Sie sollten zudem nicht als Hinweis oder Garantie für eine künftige Wertentwicklung, eine Analyse, Prognose oder Vorhersage verstanden werden. Die Informationen werden „so wie sie sind“ zur Verfügung gestellt. Der Nutzer der Informationen trägt das gesamte Risiko der Nutzung, die er vornimmt oder zulässt. Der Informationsanbieter macht keine Zusicherungen und übernimmt keine ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien (die ausdrücklich abgelehnt werden), noch haftet er für Fehler oder Auslassungen in den Informationen oder für damit verbundene Schäden. Das Vorstehende schließt weder eine Haftung aus oder beschränkt eine Haftung, die nach geltendem Recht nicht ausgeschlossen oder beschränkt werden kann. Die Informationsanbieter gelten bezüglich der Bestimmungen dieses Absatzes als Drittbegünstigte und sind berechtigt, diese Bestimmungen gegenüber Dritten durchzusetzen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

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 wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock Customised Euro Corporate Bond Index Fund 1

Unternehmenskennung:

54930004EBI21VLXNG28

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● <input type="checkbox"/> Ja	● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <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 <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ___% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> 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 der Fonds während des Berichtszeitraums beworben hat. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten aufgrund ihrer Beteiligung an den folgenden Geschäftsbereichen/Tätigkeiten (oder damit verbundenen Tätigkeiten): kontroverse Waffen, Atomwaffen, zivile Schusswaffen, Kraftwerkskohle, Tabak, Ölsande.
 Ausschluss von Unternehmen, die als gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßend eingestuft werden.
 Ausschluss von Unternehmen, die in ESG-bezogene Kontroversen verwickelt sind.

• Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Performance der Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der Erreichung der einzelnen vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale verwendet werden, wie im Prospekt des Fonds näher erläutert.

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2024	2023
Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“	# Anzahl der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Nicht zutreffend ¹

¹Es werden keine Vergleichsdaten angegeben, da dies der erste für den Fonds dargestellte Bezugszeitraum ist.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

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 (Fortsetzung)

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren im vorangegangenen Berichtszeitraum (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dessen ungeachtet können bestimmte nachhaltige Anlagen 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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die 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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen 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 Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

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 (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen („E&S-Kriterien“), die oben dargelegt sind (siehe „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Investmentmanager hat festgestellt, dass diese PAIs als Teil der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds stimmt unter Umständen nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition des entsprechenden PAI überein, der in Anhang 1 zur Verordnung (EU) 2019/2088 Regulatory Technical Standards (technische Regulierungsstandards, „RTS“) aufgeführt ist.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten aufgrund ihrer Beteiligung an den folgenden Geschäftsbereichen/Tätigkeiten (oder damit verbundenen Tätigkeiten): Kraftwerkskohle, Ölsande.
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Ausschluss von Unternehmen, die als gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßend eingestuft werden
Engagement in umstrittenen Waffen (Anti-personenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Ausschluss von Emittenten aufgrund ihrer Beteiligung an den folgenden Geschäftsbereichen/Tätigkeiten (oder damit verbundenen Tätigkeiten): kontroverse Waffen, Atomwaffen, zivile Schusswaffen, Kraftwerkskohle, Tabak, Ölsande.



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. April 2023 bis zum 31. März 2024.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BLK LEAF Fund Agency Acc T0 EUR	Finanzunternehmen	0,32 %	Irland
UBS Group AG MTN Regs 2029-03-01	Banken	0,15 %	Schweiz
Coöperatieve Rabobank JA MTN Regs 2026-03-23	Banken	0,10 %	Niederlande
BNP Paribas SA MTN Regs 2027-01-23	Banken	0,10 %	Frankreich
UBS Group AG Regs 2026-11-03	Banken	0,10 %	Schweiz
Anheuser-Busch InBev NV MTN Regs 2036-03-17	Basiskonsumgüter	0,09 %	Belgien
BP Capital Markets Plc NC6 Regs 2079-12-31	Energie	0,09 %	Vereinigtes Königreich
JPMorgan Chase & Co MTN Regs 2030-03-23	Banken	0,09 %	Vereinigte Staaten
Anheuser-Busch InBev NV MTN Regs 2028-03-17	Basiskonsumgüter	0,09 %	Belgien
Banque Fédérative du Crédit Mutuel MTN Regs 2026-05-11	Banken	0,09 %	Frankreich
Robert Bosch GmbH MTN Regs 2043-06-02	Zyklische Konsumgüter	0,09 %	Deutschland
BNP Paribas SA MTN Regs 2029-01-13	Banken	0,09 %	Frankreich
CA Auto Bank SPA (Dublin Branch) MTN Regs 2026-06-08	Zyklische Konsumgüter	0,09 %	Irland
Crédit Agricole SA MTN Regs 2034-11-28	Banken	0,09 %	Frankreich
NatWest Group Plc MTN Regs 2028-09-06	Banken	0,09 %	Vereinigtes Königreich

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

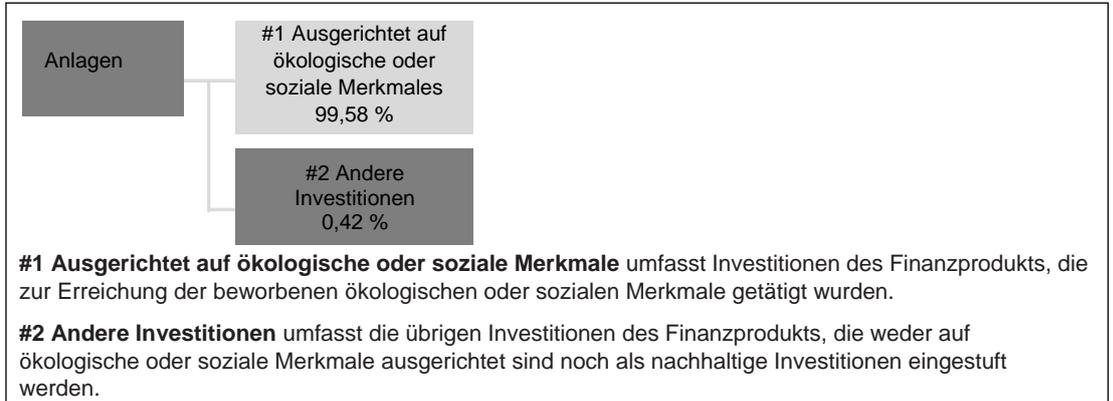
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



Der Fonds hat sich nicht verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten, weshalb das Fondsenagement bei nachhaltigen Anlagen nicht bewertet wurde. Dessen ungeachtet war ein Prozentsatz der Fondsanlagen im Bezugszeitraum an der EU-Taxonomie ausgerichtet (siehe den Abschnitt „In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?“ unten).

Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2024	2023
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,58 %	k. A. ¹
#2 Andere	0,42 %	k. A. ¹

¹Es werden keine Vergleichsdaten angegeben, da dies der erste für den Fonds dargestellte Bezugszeitraum ist.

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	31,67 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	6,08 %
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel und Getränke	4,78 %
Strom	Strom	4,68 %
Kommunikation	Festnetz	4,33 %
Basiskonsumgüter	Gesundheitswesen	3,32 %
Energie	Integriert	3,29 %
Technologie	Technologie	3,17 %
Basiskonsumgüter	Pharma	3,06 %
Versicherungen	Lebensversicherung	3,04 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	3,03 %
Transport	Verkehrsdienstleistungen	2,93 %
Investitionsgüter	Diversifizierte Produktion	2,87 %
Grundstoffe	Chemikalien	2,32 %
Erdgas	Erdgas	2,23 %
Investitionsgüter	Baustoffe	1,78 %
Basiskonsumgüter	Konsumgüter	1,73 %
Zyklische Konsumgüter	Zyklische Konsumgüter	1,57 %
Versicherungen	Sach- und Unfallversicherer	1,34 %
Zyklische Konsumgüter	Einzelhändler	1,20 %
REITs	Einzelhandel-REIT	1,14 %
Kommunikation	Medien und Unterhaltung	1,11 %

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

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 (Fortsetzung)

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
REITs	Sonstige REIT	1,09 %
Kommunikation	Mobilfunk	1,02 %
Energie	Ölfelddienstleistungen	0,18 %
Energie	Unabhängig	0,14 %
Energie	Raffinerie	0,09 %
Energie	Midstream	0,02 %

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): integriert oder Metall- und Bergbau.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**



Ja



In fossiles Gas



In Kernenergie



Nein

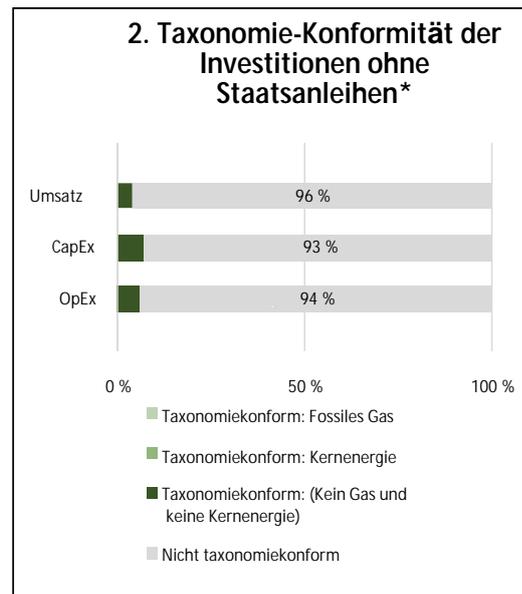
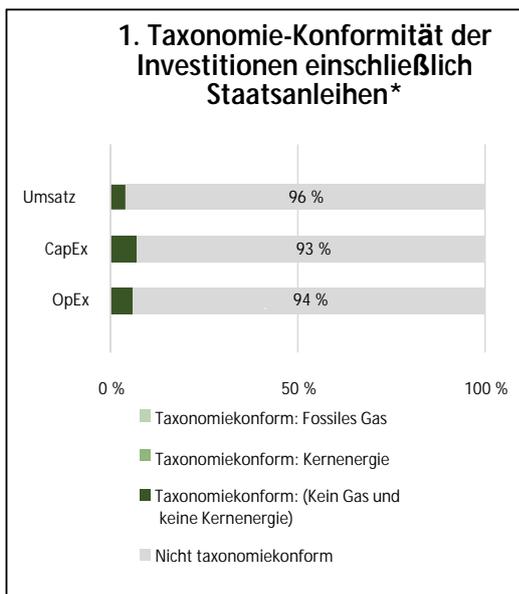
¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundenen Tätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

In dem nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe 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.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Für den Bezugszeitraum wurden 0,00 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

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 (Fortsetzung)

Taxonomie-Konformität (einschließlich Staatsanleihen)	Umsatz	CapEx	OpEx
Taxonomiekonform: Fossiles Gas	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Kernenergie	0,02 %	0,01 %	0,01 %
Taxonomiekonform: (Kein Gas und keine Kernenergie)	3,83 %	7,26 %	5,84 %
Nicht taxonomiekonform	96,15 %	92,73 %	94,15 %

Taxonomie-Konformität (ohne Staatsanleihen)	Umsatz	CapEx	OpEx
Taxonomiekonform: Fossiles Gas	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Kernenergie	0,02 %	0,01 %	0,01 %
Taxonomiekonform: (Kein Gas und keine Kernenergie)	3,83 %	7,26 %	5,84 %
Nicht taxonomiekonform	96,15 %	92,73 %	94,15 %

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

Ökologische Ziele	Investitionen
Klimaschutz	3,54 %
Anpassung an den Klimawandel	0,01 %
Konformität gesamt %	3,55 %

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomie-Konformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

	% der Investitionen
Eigene Performance	1,65 %
Übergangstätigkeiten	0,14 %
Ermöglichende Tätigkeiten	2,05 %
Konformität gesamt %	3,84 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.

 *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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Investitionen, die unter „#2 Andere Investitionen“ erfasst sind, schließen Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Derivate ein. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Anlagen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK CUSTOMISED EURO CORPORATE BOND INDEX FUND 1

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 (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageverwalter überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Anlageverwalter davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Verbesserungsmaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Anlageverwalter mit dem Emittenten Verbesserungsmaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageverwalter kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **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 UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED 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 wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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 Defensive Yield ESG Screened Fund

Unternehmenskennung:

549300HGWERLUYL3SS73

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <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 <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ___ % an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> 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 der Fonds während des Berichtszeitraums beworben hat. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition herstellen, die zum Vertrieb an Zivilpersonen bestimmt sind.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten
- Ausschluss von Emittenten mit einem ESG-Rating von CCC oder niedriger gemäß MSCI.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED 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 (Fortsetzung)

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Performance der Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der Erreichung der einzelnen vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale verwendet werden, wie im Prospekt des Fonds näher erläutert.

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2024	2023
Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“	# Anzahl der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren im vorangegangenen Berichtszeitraum (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dessen ungeachtet können bestimmte nachhaltige Anlagen 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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die 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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

Bei den **wichtigsten nachhaltigen 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 Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED 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 (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt
Engagement in umstrittenen Waffen (Anti-personenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen



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. April 2023 bis zum 31. März 2024.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BLK LEAF Fund Agency Acc T0 EUR	Finanzunternehmen	1,26 %	Irland
Berry Global Inc Regs 2025-01-15	Investitionsgüter	0,85 %	Vereinigte Staaten
Digital Euro Finco LLC Regs 2024-04-15	REITs	0,79 %	Vereinigte Staaten
James Hardie International Finance Regs 2026-10-01	Investitionsgüter	0,77 %	Irland
Rolls-Royce Plc Regs 2026-02-16	Investitionsgüter	0,72 %	Vereinigtes Königreich
Arion Banki HF MTN Regs 2025-07-14	Banken	0,69 %	Island
Banque Fédérative du Crédit Mutuel MTN Regs 2029-03-13	Banken	0,67 %	Frankreich
ABN AMRO Bank NV MTN Regs 2028-10-20	Banken	0,67 %	Niederlande
Sage Group Plc MTN Regs 2028-02-15	Technologie	0,67 %	Vereinigtes Königreich
Skandinaviska Enskilda Banken AB MTN Regs 2025-11-24	Banken	0,65 %	Schweden
Getlink SE Regs 2025-10-30	Transport	0,64 %	Frankreich
Samvardhana Motherson Automotive Regs 2024-07-06	Zyklische Konsumgüter	0,64 %	Niederlande
Vivendi SE MTN Regs 2025-06-11	Kommunikation	0,62 %	Frankreich
Goodman Australia Finance Pty Ltd Regs 2025-09-27	REITs	0,62 %	Australien
JPMorgan Chase & Co MTN Regs 2028-05-18	Banken	0,61 %	Vereinigte Staaten

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED FUND

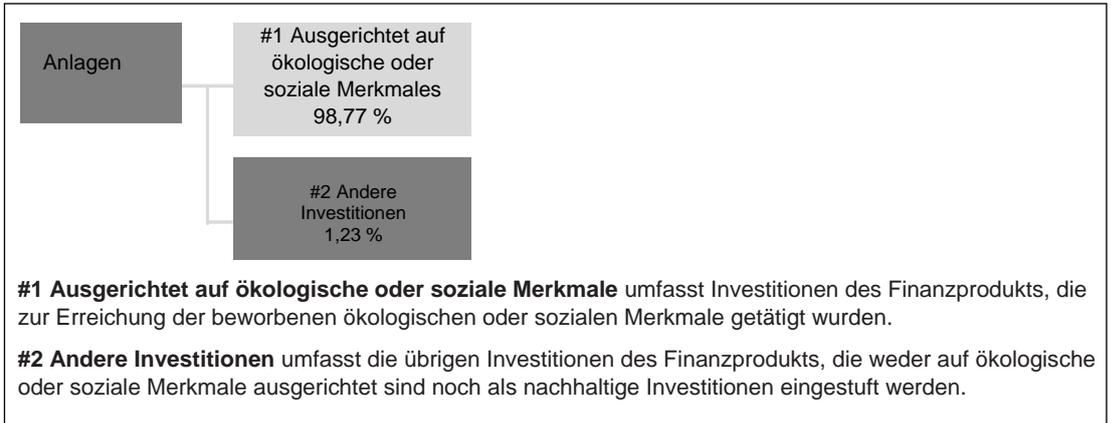
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Der Fonds hat sich nicht verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten, weshalb das Fondsenagement bei nachhaltigen Anlagen nicht bewertet wurde. Dessen ungeachtet war ein Prozentsatz der Fondsanlagen im Bezugszeitraum an der EU-Taxonomie ausgerichtet (siehe den Abschnitt „In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?“ unten).

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2024	2023
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,77 %	99,99 %
#2 Andere	1,23 %	0,01 %

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	27,19 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	7,87 %
Technologie	Technologie	4,64 %
Basiskonsumgüter	Pharma	4,34 %
Basiskonsumgüter	Gesundheitswesen	3,63 %
Transport	Verkehrsdienstleistungen	3,42 %
Grundstoffe	Chemikalien	3,36 %
Investitionsgüter	Diversifizierte Produktion	3,20 %
Sonstige Finanzwerte	Sonstige Finanzwerte	2,90 %
Kommunikation	Mobilfunk	2,54 %
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel und Getränke	2,51 %
Strom	Strom	2,45 %
Kommunikation	Festnetz	2,27 %
REITs	Sonstige REIT	2,26 %
Investitionsgüter	Baustoffe	2,15 %
Kommunikation	Medien und Unterhaltung	2,01 %
Investitionsgüter	Verpackungen	1,85 %
Zyklische Konsumgüter	Zyklische Konsumgüter	1,71 %
Finanzunternehmen	Finanzunternehmen	1,60 %
Basiskonsumgüter	Konsumgüter	1,48 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	1,38 %
Transport	Fluggesellschaften	1,25 %
Kommunikation	Drahtgebundene Kommunikation und Kabel	1,19 %
Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	1,13 %
Energie	Integriert	1,03 %
Energie	Raffinerie	0,13 %
Energie	Ölfeldleistungen	0,10 %

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED 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 (Fortsetzung)

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Unabhängig, Midstream, Metall- und Bergbau.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja**
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein**

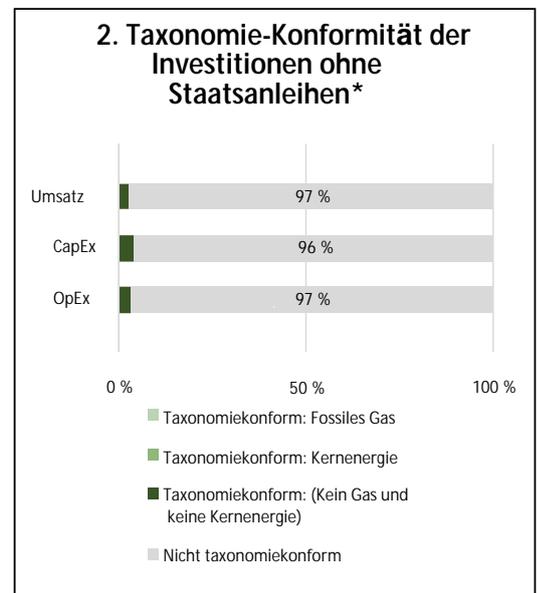
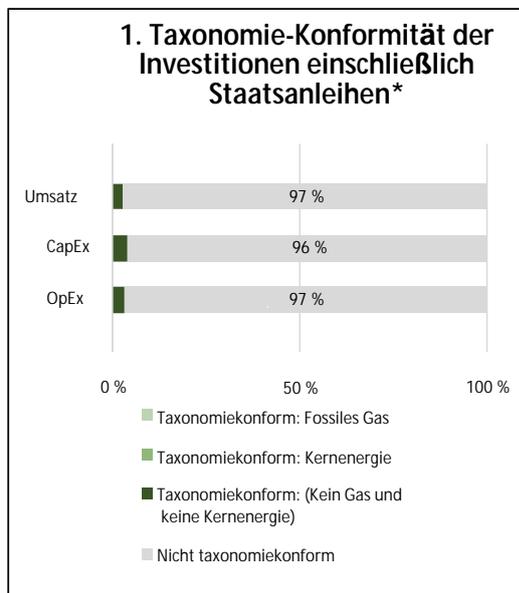
¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundenen Tätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

In dem nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe 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.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Für den Bezugszeitraum wurden 0,00 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten.

Taxonomie-Konformität (einschließlich Staatsanleihen)	Umsatz	CapEx	OpEx
Taxonomiekonform: Fossiles Gas	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Kernenergie	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: (Kein Gas und keine Kernenergie)	2,64 %	4,06 %	3,08 %
Nicht taxonomiekonform	97,36 %	95,94 %	96,91 %

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED 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 (Fortsetzung)

Taxonomie-Konformität (ohne Staatsanleihen)	Umsatz	CapEx	OpEx
Taxonomiekonform: Fossiles Gas	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Kernenergie	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: (Kein Gas und keine Kernenergie)	2,64 %	4,06 %	3,08 %
Nicht taxonomiekonform	97,36 %	95,94 %	96,91 %

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

Ökologische Ziele	Anlagen
Klimaschutz	2,61 %
Anpassung an den Klimawandel	0,01 %
Konformität gesamt %	2,62 %

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomie-Konformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

	% der Investitionen
Eigene Performance	0,73 %
Übergangstätigkeiten	0,15 %
Ermöglichende Tätigkeiten	1,75 %
Konformität gesamt %	2,63 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.

 *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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Barmittel, Geldmarktfonds und Derivate sowie Aktien oder Anteile von CIS und festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. Diese Bestände überstiegen jedoch nicht 20 %. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Anlagen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK DEFENSIVE YIELD ESG SCREENED 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 (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageverwalter überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Anlageverwalter davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Verbesserungsmaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Anlageverwalter mit dem Emittenten Verbesserungsmaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageverwalter kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **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 UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS 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 wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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 Emerging Markets Equity Fund

Unternehmenskennung:

549300DJYX0XC4W2SA54

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <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 <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ___ % an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> 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 der Fonds während des Berichtszeitraums beworben hat. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition herstellen, die zum Vertrieb an Zivilpersonen bestimmt sind.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS 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 (Fortsetzung)

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Performance der Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der Erreichung der einzelnen vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale verwendet werden, wie im Prospekt des Fonds näher erläutert.

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2024	2023
Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“	# Anzahl der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren im vorangegangenen Berichtszeitraum (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dessen ungeachtet können bestimmte nachhaltige Anlagen 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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die 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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen 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 Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS 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 (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt
Engagement in umstrittenen Waffen (Anti-personenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen



Welche sind die Hauptinvestitionen¹ dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Vom 12. Juni 2023 bis zum 27. Juni 2023.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Treasury Bill	Geldmarktpapiere	17,68 %	Vereinigte Staaten
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Informationstechnologie	6,58 %	Taiwan (Republik China)
Tencent Holdings Ltd	Kommunikation	4,80 %	China
Samsung Electronics Ltd	Informationstechnologie	4,07 %	Republik Korea (Südkorea)
Alibaba Group Holding Ltd	Nicht-Basiskonsumgüter	3,15 %	China
China Construction Bank Corp 'H'	Finanzunternehmen	1,49 %	China
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	Finanzunternehmen	1,35 %	China
Mediatek Inc	Informationstechnologie	1,31 %	Taiwan (Republik China)
Shimao Group Holdings Ltd	Immobilien	1,30 %	Hongkong
Bank Central Asia	Finanzunternehmen	1,28 %	Indonesien
JD.com Class A Inc	Nicht-Basiskonsumgüter	1,27 %	China
Bank Rakyat Indonesia (Persero)	Finanzunternehmen	1,21 %	Indonesien
Saudi Basic Industries	Werkstoffe	1,10 %	Saudi-Arabien
Delta Electronics Inc	Informationstechnologie	1,09 %	Taiwan (Republik China)
Naver Corp	Kommunikation	1,08 %	Republik Korea (Südkorea)

¹Der Fonds wurde am 27. Juni 2023 vollständig zurückgenommen. Die in der obigen Tabelle angegebenen Daten sind repräsentativ für die Anlagen, die zum 31. Mai 2023 gehalten wurden, d. h. die des letzten vor der Auflösung erstellten Monatsberichts.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS EQUITY FUND

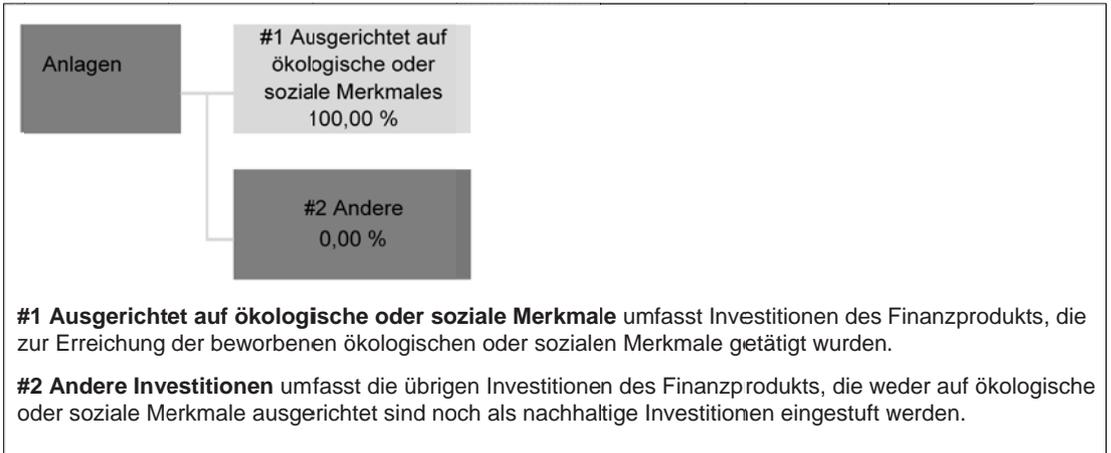
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Der Fonds hat sich nicht verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten, weshalb das Fondsengagement bei nachhaltigen Anlagen nicht bewertet wurde. Dessen ungeachtet war ein Prozentsatz der Fondsanlagen im Bezugszeitraum an der EU-Taxonomie ausgerichtet (siehe den Abschnitt „In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?“ unten).

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2024 ¹	2023
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	100,00 %	89,45 %
#2 Andere	0,00 %	10,55 %

¹Der Fonds wurde am 27. Juni 2023 vollständig zurückgenommen. Die in der obigen Tabelle angegebenen Daten sind repräsentativ für die Anlagen, die zum 31. Mai 2023 gehalten wurden, d. h. die des letzten vor der Auflösung erstellten Monatsberichts.

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Der Fonds hat sich nicht verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten, weshalb das Fondsengagement bei nachhaltigen Anlagen nicht bewertet wurde. Dessen ungeachtet war ein Prozentsatz der Fondsanlagen im Bezugszeitraum an der EU-Taxonomie ausgerichtet (siehe den Abschnitt „In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?“ unten).

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Geldmarktpapiere	Geldmarktpapiere	17,68 %
Finanzunternehmen	Banken	14,52 %
Informationstechnologie	Halbleiter und Halbleiterausüstung	9,97 %
Informationstechnologie	Tech-Hardware und -ausrüstung	8,38 %
Werkstoffe	Werkstoffe	8,19 %
Kommunikation	Medien und Unterhaltung	8,03 %
Nicht-Basiskonsumgüter	Nicht-Basiskonsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	6,34 %
Industrie	Investitionsgüter	4,78 %
Versorger	Versorger	3,41 %
Nicht-Basiskonsumgüter	Verbraucherdienstleistungen	3,26 %
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel, Getränke und Tabak	2,88 %
Nicht-Basiskonsumgüter	Autos und Autoteile	2,82 %
Finanzunternehmen	Versicherungen	2,64 %
Finanzunternehmen	Finanzdienstleistungen	1,63 %
Immobilien	Immobilienverwaltung und -entwicklung	1,55 %
Basiskonsumgüter	Haushalts- & Körperpflegeprodukte	1,54 %

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS 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 (Fortsetzung)

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Kommunikation	Telekommunikation	1,51 %
Gesundheit	Medizintechnik und -dienste	1,49 %

¹Der Fonds wurde am 27. Juni 2023 vollständig zurückgenommen. Die in der obigen Tabelle angegebenen Daten sind repräsentativ für die Anlagen, die zum 31. Mai 2023 gehalten wurden, d. h. die des letzten vor der Auflösung erstellten Monatsberichts.

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im globalen Branchenklassifikationssystem definiert): integrierte Öl- und Gasunternehmen, Öl- und Gasexploration und -herstellung, Öl- und Gasbohrungen, Öl- und Gaslagerung und -transport, Öl- und Gasraffination und -vertrieb oder Kohle und fossile Brennstoffe.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

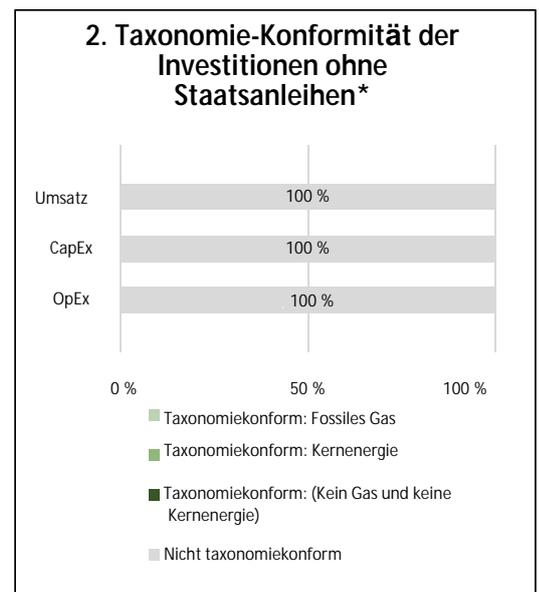
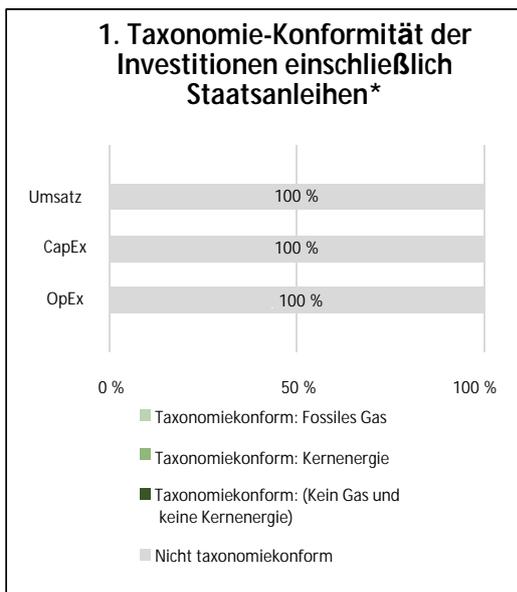
¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundenen Tätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

In dem nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe 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.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Für den Bezugszeitraum wurden 0,00 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS 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 (Fortsetzung)



*Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**
Für den Bezugszeitraum wurden 0 % der Investitionen des Fonds im Sinne dieses Berichts als Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten ausgewiesen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen* mit einem Umweltziel?

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Barmittel, Geldmarktfonds und Derivate sowie Aktien oder Anteile von CIS und festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. Diese Bestände überstiegen jedoch nicht 30 %. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Anlagen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageverwalter überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Anlageverwalter davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Verbesserungsmaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Anlageverwalter mit dem Emittenten Verbesserungsmaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageverwalter kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.

Der Anlageverwalter unterliegt auch den Anforderungen zur Mitwirkung von Aktionären der Aktionärsrechterichtlinie II (ARUG II). Die ARUG soll die Position der Aktionäre stärken, die Transparenz fördern und übermäßige Risiken in Unternehmen verringern, die auf geregelten Märkten in der EU gehandelt werden. Weitere Einzelheiten zu den Aktivitäten des Investmentmanagers gemäß ARUG sind auf der Website von BlackRock abrufbar.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK SYSTEMATIC ESG EMERGING MARKETS 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 (Fortsetzung)



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **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 UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

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 wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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 Euro Investment Grade Fixed Maturity Bond Fund 2026

Unternehmenskennung:

EUIGMBF2027

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von _____ % an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel 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	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____%	<input checked="" type="checkbox"/> 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 der Fonds während des Berichtszeitraums beworben hat. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den nachfolgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“. Er gibt Auskunft darüber, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt hat.

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen (insbesondere Streumunition, biologischchemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Laserblendwaffen, nicht erkennbarer Teile und/oder Brandwaffen) tätig sind oder anderweitig damit in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die Einkünfte aus der direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Komponenten von Atomwaffen oder Lieferplattformen oder der Erbringung von Zusatzleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Handel und Angebot von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition herstellen, die zum Vertrieb an Zivilpersonen bestimmt sind.
- Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Handfeuerwaffen und Munition für zivile Zwecke erzielen.
- Ausschluss von Emittenten, die nicht als die UNGC-Grundsätze (die sich auf Menschenrechte, Arbeitsstandards, die Umwelt und die Bekämpfung von Korruption beziehen) erfüllt zu haben gelten
- Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung und/oder dem Verkauf von konventionellen Waffen (einschließlich Munition) beteiligt sind.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

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 (Fortsetzung)

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Performance der Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der Erreichung der einzelnen vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale verwendet werden, wie im Prospekt des Fonds näher erläutert.

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2024	2023
Ausschluss von Emittenten auf der Grundlage der in obiger Tabelle definierten Ausschlusskriterien „Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale“	# Anzahl der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Nicht zutreffend ¹

¹Es werden keine Vergleichsdaten angegeben, da dies der erste für den Fonds dargestellte Bezugszeitraum ist.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die obige Tabelle gibt Aufschluss über die Leistung der Nachhaltigkeitsindikatoren im vorangegangenen Berichtszeitraum (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

- **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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dessen ungeachtet können bestimmte nachhaltige Anlagen 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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein. Bitte beachten Sie den folgenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“, in dem beschrieben wird, wie der Fonds die 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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen 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 Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

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 (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Herstellung und Erzeugung von Teersanden (auch Ölsande genannt) erzielen
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Einkünfte aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ dieser Emittenten, die als konform mit den „Green Bond Principles“ der International Capital Markets Association gelten
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt
Engagement in umstrittenen Waffen (Anti-personenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
Engagements in Emittenten, die an der Herstellung und/oder dem Verkauf von konventionellen Waffen (einschließlich Munition) beteiligt sind.	Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung und/oder dem Verkauf von konventionellen Waffen (einschließlich Munition) beteiligt sind.



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 9. Mai 2023 bis zum 31. März 2024.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Germany (Federal Republic of) Regs 2023-07-19	US-Schatzwechsel	4,13 %	Deutschland
Belgium Kingdom of (Government) 2023-07-13	US-Schatzwechsel	4,02 %	Belgien
France (Republic of) Regs 2023-07-19	US-Schatzwechsel	3,96 %	Frankreich
European Union 2023-08-04	Staatsnahe Titel	3,70 %	Supranational
European Stability Mechanism 2023-08-03	Staatsnahe Titel	2,60 %	Supranational
Wells Fargo & Company MTN Regs 2026-04-27	Banken	2,36 %	Vereinigte Staaten
Banque Fédérative du Crédit Mutuel MTN Regs 2026-05-11	Banken	2,36 %	Frankreich
Credit Suisse AG (London Branch) MTN Regs 2026-04-10	Banken	2,36 %	Vereinigtes Königreich
Enel Finance International NV MTN Regs 2026-05-28	Strom	2,35 %	Niederlande
BPCE SA MTN Regs 2026-04-17	Banken	2,35 %	Frankreich
Lloyds Bank Corporate Markets Plc MTN Regs 2026-04-09	Banken	2,35 %	Vereinigtes Königreich
Banco Santander SA MTN Regs 2026-04-04	Banken	2,34 %	Spanien
Crédit Mutuel Arkéa MTN Regs 2026-04-15	Banken	2,34 %	Frankreich
British Telecommunications Plc MTN Regs 2026-03-10	Kommunikation	2,34 %	Vereinigtes Königreich
RWE AG Regs 2026-05-24	Strom	2,32 %	Deutschland

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

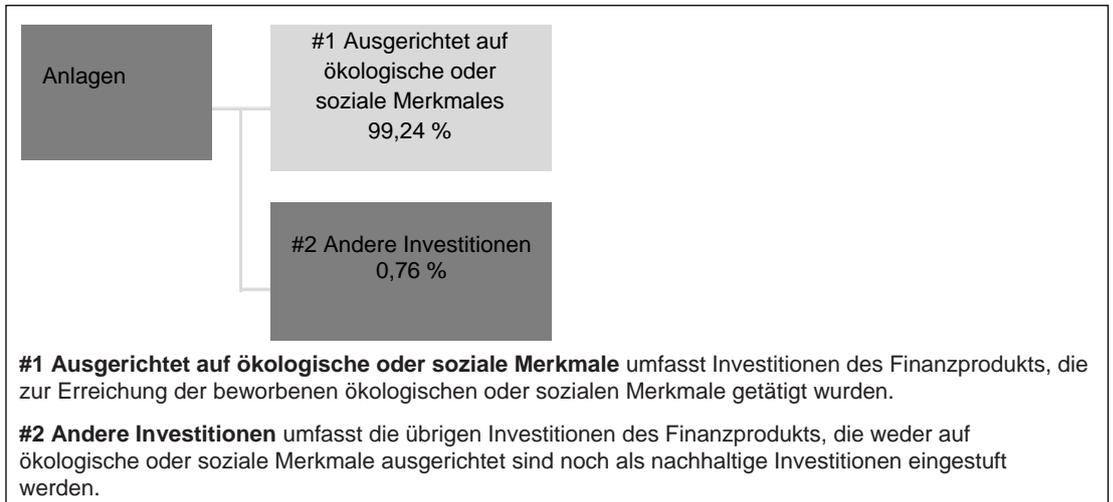
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



Die folgende Tabelle zeigt die Vermögensaufteilung des Fonds für den laufenden und den vorangegangenen Berichtszeitraum.

Der Fonds hat sich nicht verpflichtet, nachhaltige Anlagen zu halten, weshalb das Fondsengagement bei nachhaltigen Anlagen nicht bewertet wurde. Dessen ungeachtet war ein Prozentsatz der Fondsanlagen im Bezugszeitraum an der EU-Taxonomie ausgerichtet (siehe den Abschnitt „In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?“ unten).

Vermögensallokation	% der Investitionen	
	2024	2023
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,24 %	k. A. ¹
#2 Andere	0,76 %	k. A. ¹

¹Es werden keine Vergleichsdaten angegeben, da dies der erste für den Fonds dargestellte Bezugszeitraum ist.

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die folgende Tabelle gibt Aufschluss über die Wirtschaftssektoren, in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Banken	Banken	40,52 %
US-Schatzwechsel	US-Schatzwechsel	14,09 %
Zyklische Konsumgüter	Auto	8,58 %
Strom	Strom	6,95 %
Staatsnahe Titel	Supranational	6,30 %
Transport	Verkehrsdienstleistungen	3,10 %
Staatsnahe Titel	Agency-Anleihen	2,38 %
Kommunikation	Festnetz	2,34 %
Kommunikation	Mobilfunk	2,28 %
Basiskonsumgüter	Gesundheitswesen	2,26 %
Staatsnahe Titel	Kommunalanleihen	2,00 %
Investitionsgüter	Baustoffe	1,85 %
Technologie	Technologie	1,67 %
Investitionsgüter	Diversifizierte Produktion	1,43 %
Investitionsgüter	Verpackungen	1,39 %
Energie	Integriert	0,01 %

Im Bezugszeitraum hielt der Fonds keine Investitionen in den folgenden Teilsektoren (wie im Branchenklassifikationssystem von Barclays definiert): Integriert, Unabhängig, Midstream, Ölfelddienstleistungen, Raffination oder Metall- und Bergbauunternehmen.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

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 (Fortsetzung)

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



In welchem Maß waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Bezugszeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in nachstehenden Grafiken ausgewiesen.

• Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

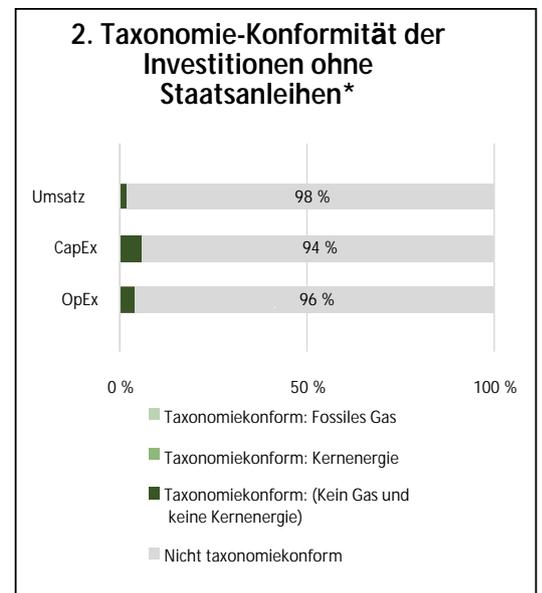
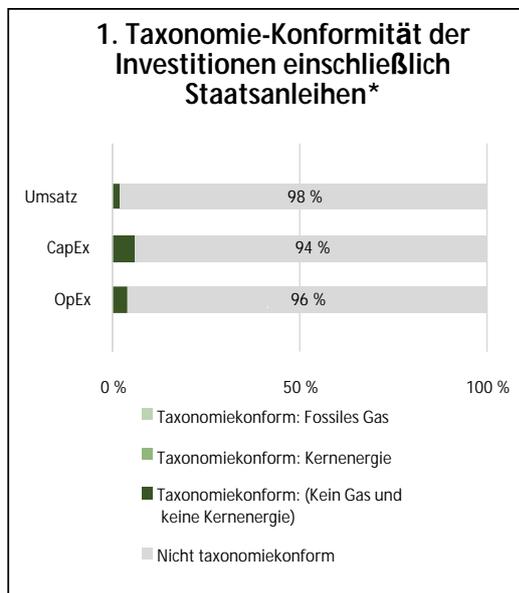
¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundenen Tätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

In dem nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Brennstoffe 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.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Für den Bezugszeitraum wurden 24,44 % der Investitionen des Fonds in Staatsanleihen gehalten. Aufgrund der begrenzten Verfügbarkeit von Daten konnte die Taxonomie-Konformität dieser Engagements nicht ermittelt werden.

Taxonomie-Konformität (einschließlich Staatsanleihen)	Umsatz	CapEx	OpEx
Taxonomiekonform: Fossiles Gas	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Kernenergie	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: (Kein Gas und keine Kernenergie)	1,80 %	5,83 %	3,94 %
Nicht taxonomiekonform	98,20 %	94,17 %	96,06 %

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

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 (Fortsetzung)

Taxonomie-Konformität (ohne Staatsanleihen)	Umsatz	CapEx	OpEx
Taxonomiekonform: Fossiles Gas	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Kernenergie	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: (Kein Gas und keine Kernenergie)	1,81 %	5,91 %	3,99 %
Nicht taxonomiekonform	98,19 %	94,09 %	96,01 %

Die vom Fonds während des Bezugszeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden ökologischen Zielen der EU-Taxonomie bei:

Ökologische Ziele	Anlagen
Klimaschutz	1,78 %
Anpassung an den Klimawandel	0,02 %
Konformität gesamt %	1,80 %

Die in der obigen Tabelle dargestellten Daten sind ungeprüft und wurden weder vom Abschlussprüfer des Fonds noch von einer dritten Partei geprüft. Die Bewertung der Konformität mit der EU-Taxonomie basiert auf den Daten eines externen Anbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus gleichwertigen und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, führen zu einem Ergebnis in Bezug auf die Eignung oder die Taxonomie-Konformität der Unternehmen, für die uns keine gemeldeten Daten vorliegen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum beliefen sich die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten wie folgt:

	% der Investitionen
Eigene Performance	0,86 %
Übergangstätigkeiten	0,07 %
Ermöglichende Tätigkeiten	0,86 %
Konformität gesamt %	1,79 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Für den vorherigen Bezugszeitraum waren 0 % der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie konform.



*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 ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieser Abschnitt ist für diesen Fonds nicht anwendbar, da er sich nicht verpflichtet hat, während des Bezugszeitraums nachhaltige Anlagen zu halten. Dennoch können bestimmte nachhaltige Anlagen Teil des Anlageportfolios des Fonds sein.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Barmittel, Geldmarktfonds und Derivate sowie Aktien oder Anteile von CIS und festverzinsliche Wertpapiere (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. Diese Bestände überstiegen jedoch nicht 20 %. Diese Investitionen wurden ausschließlich zu Anlagezwecken im Rahmen des (nicht-ESG-konformen) Anlageziels des Fonds, zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und/oder zur Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Anlagen wurden anhand von ökologischen oder sozialen Mindeststandards bewertet.

BLACKROCK UCITS FUNDS

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

BLACKROCK EURO INVESTMENT GRADE FIXED MATURITY BOND FUND 2026

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 (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat interne Qualitätskontrollen wie z. B. die Kodierung von Compliance-Regeln eingeführt, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageverwalter überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie in Hinsicht auf das Anlageuniversum des Fonds weiterhin angemessen sind.

Wenn Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert werden, werden sie überprüft, um sicherzustellen, dass der Anlageverwalter davon überzeugt ist, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, dass der Emittent entweder Verbesserungsmaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens auf der Grundlage der direkten Kommunikation des Anlageverwalter mit dem Emittenten Verbesserungsmaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageverwalter kann außerdem beschließen, das Engagement in solchen Emittenten zu reduzieren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Bezugszeitraum wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt, weshalb dieser Abschnitt nicht anwendbar ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **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 UCITS FUNDS

HAFTUNGSAUSSCHLÜSSE

Haftungsausschluss für Bezugnahmen auf den Benchmarkindex und die Website des Indexanbieters

Gemäß den Vorschriften der Zentralbank muss die Verwaltungsgesellschaft im Namen der Indexfonds Angaben zur Website („Website“) des jeweiligen Indexanbieters machen, um es den Anteilhabern zu ermöglichen, weitere Informationen zu dem Benchmarkindex des jeweiligen Fonds (einschließlich der Indexkomponenten) zu erhalten. Die Verwaltungsgesellschaft ist für die jeweilige Website nicht verantwortlich und ist auf keine Weise an einer Unterstützung oder Empfehlung oder anderweitig an der Einrichtung oder Aufrechterhaltung der jeweiligen Website oder ihrer Inhalte beteiligt. Die Verwaltungsgesellschaft ist weiterhin nicht für den Benchmarkindex des Indexanbieters verantwortlich oder für die Qualität, Richtigkeit oder Vollständigkeit der Daten ihrer Benchmarkindizes oder dafür, dass die veröffentlichten Indizes in Übereinstimmung mit ihren beschriebenen Indexmethoden verwaltet werden.

Haftungsausschlüsse des Indexanbieters

Die Benchmarkindizes werden nicht verwaltet, und es kann nicht direkt in sie investiert werden. Die Entwicklung oder Auflegung eines Produkts, das einen Barclays-Index verwendet, darauf basiert oder im Zusammenhang damit entwickelt wurde (jeweils ein „Produkt“), ist ohne die vorherige schriftliche Genehmigung von Barclays Risk Analytics and Index Solutions („BRAIS“) verboten. Diese Produkte werden von BRAIS nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben, und BRAIS gibt keine Erklärungen bezüglich der Ratsamkeit einer Anlage in diese Produkte ab.

Barclays ist nicht als Anlageberater oder Treuhänder tätig. Dieser Prospekt stellt keine persönliche Anlageberatung dar und berücksichtigt auch nicht die individuellen finanziellen Umstände oder Ziele eines Anlegers. Die hier besprochenen Indizes, Wertpapiere, Rohstoffe, Währungen, Derivate und sonstigen Finanzprodukte sind möglicherweise nicht für alle Zwecke oder für alle Anleger geeignet. Dementsprechend müssen Empfänger nach Absprache mit ihren eigenen Beratern unabhängig entscheiden, ob ein hier besprochener Index oder eine hier besprochene Anlage für ihre Zwecke geeignet ist.

Die Indexdaten, quantitativen Modelle, Analyseinstrumente und sonstigen Informationen („Inhalt“), auf die in diesem Prospekt Bezug genommen wird, werden von Barclays als zuverlässig erachtet. Barclays sichert jedoch nicht zu, dass der Inhalt (einschließlich der aus Drittquellen bezogenen Informationen) korrekt, vollständig oder fehlerfrei ist, und er sollte daher nicht derart angesehen werden. Der Inhalt wird nur zu Informationszwecken und ohne Mängelgewähr zur Verfügung gestellt. Barclays garantiert nicht die Richtigkeit, Zeitnähe, Zuverlässigkeit, Performance, kontinuierliche Verfügbarkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der Inhalte, und Barclays übernimmt keine Haftung für darin enthaltene Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen. Jegliche im Inhalt enthaltenen Daten über die vergangene Wertentwicklung, Modelle oder Rückvergleiche (Back-Testing) sind kein Indikator für die künftige Wertentwicklung. Es wird keine Erklärung zur Plausibilität der in den Modellen oder beim Back-Testing getroffenen Annahmen oder bezüglich deren Richtigkeit oder Vollständigkeit abgegeben. Da die Möglichkeit menschlicher oder technischer Fehler sowie anderer Faktoren besteht, übernimmt Barclays keine Haftung für Fehler oder Auslassungen im Inhalt (insbesondere bezüglich der Berechnung oder Performance eines Index und/oder des Ergebnisses eines quantitativen Modells oder analytischen Tools). Barclays übernimmt keinerlei Haftung für die Korrektheit, Zeitnähe, Zuverlässigkeit, Performance, kontinuierliche Verfügbarkeit, Vollständigkeit oder Aktualität des Inhalts oder für Verzögerungen oder Auslassungen darin oder für Unterbrechungen der Lieferung von Inhalten oder für konkrete Schäden, Strafe einschließenden Schadenersatz, mittelbare, Neben- oder Folgeschäden, die durch die Verwendung von oder das Vertrauen auf Inhalte entstehen, selbst wenn auf die Möglichkeit derartiger Schäden hingewiesen wurde.

Die Indexrenditen stellen die Wertentwicklung der Vergangenheit dar und sind kein Indikator für eine spezielle Anlage. Der Inhalt (einschließlich aller von analytischen Tools oder Modellen stammenden Ergebnisse) dient nicht als Prognose tatsächlicher Ergebnisse, die erheblich von den dargestellten abweichen können. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist nicht unbedingt ein Indikator für zukünftige Ergebnisse.

Sie wünschen weitere Auskünfte?

[blackrockinternational.com](https://www.blackrockinternational.com) | +44 (0)20 7743 3300

© 2024 BlackRock, Inc. Alle Rechte vorbehalten. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS und iSHARES sind Marken von BlackRock, Inc. oder ihren Tochtergesellschaften in den Vereinigten Staaten und andernorts. Sämtliche Markenzeichen sind diejenigen ihrer jeweiligen Eigentümer.

BlackRock[®]

Go paperless. . .

It's Easy, Economical and Green!

Go to www.blackrock.com/edelivery

