

BlackRock[®]

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss

Institutional Cash Series plc

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

INHALT	Seite
Überblick	
Allgemeine Informationen	1
Hintergrund	3
Performance	
Bericht des Investmentmanagers	5
Governance (Unternehmensführung)	
Corporate-Governance-Erklärung	13
Bericht des Verwaltungsrats	15
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber	17
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	18
Jahresabschluss	
Gewinn- und Verlustrechnung	21
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	25
Bilanz	29
Anmerkungen zum Jahresabschluss	33
Aufstellungen der Vermögenswerte	78
Zusätzliche Informationen und aufsichtsrechtliche Angaben (ungeprüft)	
Aufstellungen wesentlicher Käufe und Verkäufe (ungeprüft)	141
Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)	155
Transaktionen mit verbundenen Personen (ungeprüft)	158
Transaktionskosten (ungeprüft)	158
Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions) (ungeprüft)	158
Wechselseitige Anlagen (ungeprüft)	159
Gesamtrisikoeexposition (ungeprüft)	159
Hebelwirkung (ungeprüft)	159
Vergütungsbericht (ungeprüft)	160
Effizientes Portfoliomanagement und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	164
Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen (ungeprüft)	171

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Verwaltungsrat¹

Barry O'Dwyer (Vorsitzender) (Ire)
Jacqueline Flynn (Irin)²
Nicola Grenham (Irin)³
Becky Tilston Hales (Britin)²
Tom McGrath (Ire)²
Karen Prooth (Britin)²

¹Nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

²Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe

³Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

Verwaltungsgesellschaft

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

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

Verwahrstelle

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

Secretary

Sanne Corporate Administration Services (Ireland) Limited
Fourth Floor
76 Baggot Street Lower
Dublin 2, D02 EK81
Irland

Eingetragener Geschäftssitz des Unternehmens

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

Investmentmanager, Hauptvertriebsgesellschaft und Unter-Investmentmanager⁴

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

US-Investmentmanager⁴

BlackRock Capital Management, Inc.
100 Bellevue Parkway
Wilmington
Delaware 19809
USA

Unabhängige Abschlussprüfer

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

Rechtsberater für irisches Recht

Matheson
70 Sir John Rogerson's
Quay Dublin 2, D02 R296
Irland

Zahlstelle in Frankreich

CACEIS Bank France
1-3 Place Valhubert
75013 Paris
Frankreich

Zahlstelle auf der Insel Man

IQ EQ (Isle of Man) Limited
(vormals Cains Fiduciaries Limited & First Names)
First Names House
Victoria Road
Douglas
Insel Man
IM2 4DF

Zahlstelle in Italien

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

Zahlstelle in der Schweiz

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

Vertreter in Dänemark

BlackRock Zweigniederlassung Kopenhagen
Harbour House
Sundkrogsgade 21
Copenhagen
DK- 2100
Dänemark

Vertreter in Südafrika

BlackRock Investment Management (UK) Limited
(Zweigniederlassung Südafrika)
First Floor
Regus Convention Towers
Crn. Of Heerngracht and Coen Steyter Street
Cape Town 8001

Vertreter in der Schweiz

BlackRock Asset Management Schweiz AG
Bahnhofstrasse 39
8001 Zürich
Schweiz

⁴US-Investmentmanager/Unter-Investmentmanager ausschließlich für bestimmte Fonds.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Für Schweizer Anleger: Der Prospekt des Unternehmens, die Satzung, die wesentlichen Informationen für den Anleger („KIID“) sowie der aktuellste Jahresbericht und geprüfte Jahresabschluss bzw. der aktuellste Halbjahresbericht und Abschluss und eine detaillierte Aufstellung aller für den jeweiligen Fonds im Laufe des Berichtszeitraums gekauften und verkauften Anlagen sind beim Vertreter in der Schweiz auf Anfrage kostenfrei erhältlich.

Bitte beachten Sie, dass für den Vertrieb der Anteile des folgenden Fonds keine Anzeige gemäß §310 des Kapitalanlagegesetzbuches für OGAW erfolgt ist: BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund. Daher dürfen Anteile dieses 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 542 eingetragen.

Geldmarktfonds („GMF“) sind kein garantiertes Anlagevehikel. Eine Anlage in GMF unterscheidet sich von der Anlage in Einlagen; das in einen GMF angelegte Kapital kann schwanken und das Risiko, das Kapital zu verlieren, trägt der Anleger. Weitere Informationen über die Fonds, u. a. die Art von GMF, in die der Fonds im Rahmen der Geldmarktfondsverordnung („GMFV“) klassifiziert ist, die vom GMF eingesetzten Methoden zur Bewertung der Vermögenswerte des GMF und zur Berechnung des Nettoinventarwerts („NIW“), stehen zur Verfügung unter <https://www.blackrock.com/cash/enzz/european-money-market-fund-reform-disclosures>. Die Kreditratings wurden von BlackRock beantragt und finanziert.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

HINTERGRUND

Institutional Cash Series Plc (das „Unternehmen“) ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Das Unternehmen wurde am 9. Dezember 1998 in Irland mit beschränkter Haftung zwischen seinen Fonds und entsprechend den Gesetzen Irlands sowie gemäß dem irischen Companies Act von 2014, in der jeweils gültigen Fassung, und den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011, in der jeweils gültigen Fassung, (die „OGAW-Vorschriften“) als Aktiengesellschaft gegründet und wird durch die irische Zentralbank („CBI“) reguliert.

Das Unternehmen besitzt die Struktur eines Umbrellafonds 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 und im Prospektnachtrag angegebenen Anlagezielen und -strategien der einzelnen Fonds angelegt.

Während Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die einer Anteilklasse innerhalb eines Fonds zuzuordnen sind, nur dieser Anteilklasse zuzurechnen sind (und von ihr getragen werden sollten), gibt es gemäß irischem Recht keine Trennung der Verbindlichkeiten zwischen Anteilklassen. Infolge der fehlenden Trennung der Verbindlichkeiten gemäß irischem Recht besteht das Risiko, dass die Gläubiger einer Anteilklasse einen Anspruch auf die Vermögenswerte des Fonds erheben, die fiktiv anderen Anteilklassen zugewiesen sind.

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 Begriffe „BlackRock“ und „Investmentmanager“ werden stellvertretend für die BlackRock Investment Management (UK) Limited und/oder die BlackRock Capital Management, Inc., wie jeweils zutreffend, verwendet. Alle Verweise auf „rückkaufbare Anteile“ beziehen sich auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile, wenn Fondsanteile als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert werden. Die Bezeichnung „Verwaltungsratsmitglieder“ bedeutet die Verwaltungsratsmitglieder des Unternehmens.

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

Details der Fonds

Zum 30. September 2022 waren 13 Fonds des Unternehmens geschäftstätig.

Veränderungen im Unternehmen im Laufe des Geschäftsjahres

Am 26. November 2021 wurde für das Unternehmen ein aktualisierter Prospekt zur Aufnahme der folgenden Änderungen veröffentlicht:

- Aktualisierungen der Benchmark-Verordnung.
- Hinzufügung von „Euro Short-Term Rate“ oder „€STR“ (Referenzzinssatz für Euro) und „Secured Overnight Financing Rate“ oder „SOFR“ (besicherte Tagesgeldfinanzierungen) und „Sterling Overnight Index Average Rate“ oder „SONIA“ zu den Definitionen.
- Streichung von Teresa O' Flynn von der Liste der Verwaltungsratsmitglieder.
- Aktualisierung in Bezug auf die vom Unternehmen zur Messung der Performance verwendeten Änderungen der Tagesgeldsätze. Die Veränderungen werden im Folgenden dargestellt.

Name des Fonds	Bisheriger Performanceindikator	Neuer Performance-Indikator
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR Overnight LIBID Index	€STR Overnight
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	7-days EUR LIBID	€STR Overnight
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	7-days EUR LIBID	€STR Overnight
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	ICE BofAML EUR 3-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index	3-Month compounded €STR in arrears
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP Overnight LIBID Index	SONIA Overnight
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	7-days GBP LIBID	SONIA Overnight
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	7-days GBP LIBID	SONIA Overnight
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	ICE BofAML GBP 3-Month LIBID	3-Month compounded SONIA in arrears
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	7-days USD LIBID	SOFR Overnight
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	7-days USD LIBID	SOFR Overnight
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	ICE BofAML USD LIBID 3-Month Average (L5US) Index	3-Month compounded SOFR in arrears
BlackRock ICS US Treasury Fund	FTSE 1-Month T-bill Index	SOFR Overnight

Am 6. Dezember 2021 wurde die Anteilklasse Heritage (CHF Hedged) für den BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund aufgelegt.

Am 6. Dezember 2021 wurden alle Anteile der Klasse Select (Acc) des BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund aufgelegt.

Am 14. Dezember 2021 wurde für das Unternehmen ein aktualisierter Prospekt zur Aufnahme der folgenden Punkte veröffentlicht:

- Einzelheiten zu den Taxonomie-Regeln der Europäischen Union (EU).
- Aktualisierungen zu den Angaben zur Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Am 15. Dezember 2021 wurden alle Anteile der Klasse Select (Acc T0) des BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund aufgelegt.

Am 22. Dezember 2021 wurde für das Unternehmen ein aktualisierter Prospekt zur Aufnahme der folgenden Punkte veröffentlicht:

- Streichung des Hinweises auf die Primär- und Sekundärmärkte.
- Streichung des Verweises auf die Handelsplattformen EuroNext Dublin/Xetra.
- Einführung verschiedener Zinssätze für verspätete/nicht erfolgte Zahlungen an den Antragsteller entsprechend der Basiswährung der Fonds.
- Aufnahme neuer Anteilklassen für den BlackRock ICS Euro Liquidity Fund und den BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund.

Am 4. Januar 2022 wurde der Vertrag mit J&E Davy als Sponsoring Broker in Irland gekündigt.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

HINTERGRUND (Fortsetzung)

Veränderungen im Unternehmen im Laufe des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Am 22. Januar 2022 verschmolz die J.P. Morgan Bank (Ireland) plc mit der J.P. Morgan AG, die dann ihre Rechtsform in eine Europäische Gesellschaft (Societas Europaea) namens J.P. Morgan SE änderte. J.P. Morgan SE wird seine Funktionen als Verwahrstelle kraft Gesetzes weiter über die J.P. Morgan SE - Zweigniederlassung Dublin ausführen.

Am 25. Januar 2022 wurden alle Anteile der Klasse Premier (Acc T2) des BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund aufgelegt.

Am 25. Januar 2022 wurden alle Anteile der Klasse Premier (Acc T2) des BlackRock ICS Euro Liquidity Fund aufgelegt.

Am 3. Februar 2022 wurde der Vertrag mit der State Street Bank International GmbH als Informationsstelle in Deutschland gekündigt, da das Erfordernis eines lokalen Vertreters in der Richtlinie über den grenzüberschreitenden Vertrieb von Geldern („Cross Border Distribution of Funds Directive“) aufgehoben wurde.

Am 8. Februar 2022 wurde der Vertrag mit der J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. als Informationsstelle in Luxemburg gekündigt, da das Erfordernis eines lokalen Vertreters in der Richtlinie über den grenzüberschreitenden Vertrieb von Geldern („Cross Border Distribution of Funds Directive“) aufgehoben wurde.

Am 1. April 2022 wurden für den BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund und den BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund die Anteile der Klasse Core (Acc T0) aufgelegt.

Am 29. April 2022 wurde für das Unternehmen ein aktualisierter Prospekt zur Aufnahme der folgenden Punkte veröffentlicht:

- Aktualisierungen zu den Brexit-Informationen im Zusammenhang mit dem Übergangszeitraum, der Nicht-Anwendung des EU-Rechtes für das Vereinigte Königreich und dem Handels- und Kooperationsabkommen zwischen der EU und dem Vereinigten Königreich für den Handel zwischen dem Vereinigten Königreich und der EU.
- Informationen über die Namensänderung der Verwahrstelle von J.P. Morgan Bank (Ireland) plc in J.P. Morgan SE - Zweigniederlassung Dublin.

Am 29. Juni 2022 wurde die Anteilklasse Core für den BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund erneut aufgelegt.

Am 27. Juli 2022 traten Paul McNaughton als Vorsitzender und als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied, Jessica Irschick als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied und Paul McGowan, Ros O'Shea und Deirdre Somers als unabhängige Verwaltungsratsmitglieder zurück.

Am 27. Juli 2022 wurden Barry O'Dwyer zum Vorsitzenden, Nicola Grenham zum unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglied und Tom McGrath und Karen Prooth zum unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder bestellt.

Am 1. August 2022 wurde der Vertrag mit der Raiffeisen Bank International AG als Informationsstelle in Österreich gekündigt, da das Erfordernis eines lokalen Vertreters in der Richtlinie über den grenzüberschreitenden Fondsvertrieb („Cross Border Distribution of Funds Directive“) aufgehoben wurde.

Am 17. September 2022 wurde Becky Tilston Hales zum nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglied bestellt.

Am 22. September 2022 wurde Jacqueline Flynn zum nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglied bestellt.

Am 29. September 2022 dekontierte BlackRock den BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund, den BlackRock ICS Euro Liquidity Fund, den BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund und den BlackRock ICS US Treasury Fund vom regulierten Markt der elektronischen Handelsplattform Xetra der Frankfurter Wertpapierbörse („Xetra“).

COVID-19-Ausbruch

Der Ausbruch des Coronavirus hat in den letzten Jahren tiefgreifende Auswirkungen auf alle Bereiche der Gesellschaft gehabt. In Industrieländern herrscht inzwischen zunehmend der Konsens, dass die schlimmsten Folgen jetzt überstanden sind. Dennoch dürften Reisebeschränkungen, verstärkte Gesundheitsprüfungen an Grenzübergangsstellen und anderswo, Störungen und Verzögerungen in der Gesundheitsversorgung, Stornierungen, Lieferkettenunterbrechungen und eine geringere Verbrauchernachfrage auch künftig noch Probleme bereiten. Inzwischen laufen zwar in vielen Ländern groß angelegte Impfprogramme, die sich positiv auswirken, doch die Volkswirtschaften vieler Länder weltweit leiden nach wie vor unter den Folgen von COVID-19. Diese könnten dort schwerwiegender ausfallen, wo die Impfquoten niedriger sind, wie zum Beispiel in bestimmten Schwellenländern. Zeitliche Prognosen sind zwar schwer zu stellen, doch voraussichtlich werden die wirtschaftlichen Effekte von COVID-19 noch eine Zeit lang zu spüren sein, wenn das Virus selbst schon vom pandemischen in den endemischen Modus übergegangen ist. Dies wiederum könnte sich weiterhin auf die vom Unternehmen gehaltenen Anlagen auswirken.

Der Verwaltungsrat hat die Auswirkungen der durch den Ausbruch von COVID-19 entstandenen Marktbedingungen auf die Fähigkeit des Fonds bewertet, sein Anlageziel zu erreichen. Auf Grundlage der neuesten verfügbaren Informationen wird der Fonds weiterhin in Übereinstimmung mit seinem Anlageziel verwaltet, ohne dass der Fondsbetrieb und die Veröffentlichung der Nettoinventarwerte („NIW“) gestört werden.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS

Anlageziel

BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Gesamtrendite in Form von Kapitalzuwachs und laufenden Erträgen zu erwirtschaften. Für weitere Einzelheiten zu der Anlagepolitik des oben genannten Fonds werden die Anleger auf den Prospektnachtrag verwiesen.

BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund

BlackRock ICS Sterling Government Liquidity

Fund BlackRock ICS US Treasury Fund

Das Anlageziel der einzelnen Fonds ist das Erzielen eines moderaten laufenden Ertrags in Einklang mit Liquidität und Stabilität des Kapitalbetrages. Für weitere Einzelheiten zu der Anlagepolitik eines jeden der oben genannten Fonds werden die Anleger auf den Prospekt verwiesen.

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund

BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund

BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

Das Anlageziel der einzelnen Fonds ist die Erzielung einer den Geldmarktsätzen entsprechenden Rendite bei gleichzeitigem Kapital- und Liquiditätserhalt durch die Verwaltung eines Portfolios von qualitativ hochwertigen kurzfristigen Geldmarktinstrumenten. Für weitere Einzelheiten zu der Anlagepolitik eines jeden der oben genannten Fonds werden die Anleger auf den Prospekt verwiesen.

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

Das Anlageziel der einzelnen Fonds ist die Maximierung der laufenden Erträge bei gleichzeitigem Kapital- und Liquiditätserhalt durch die Verwaltung eines Portfolios von qualitativ hochwertigen kurzfristigen Geldmarktinstrumenten. Für weitere Einzelheiten zu der Anlagepolitik eines jeden der oben genannten Fonds werden die Anleger auf den Prospekt verwiesen.

BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund

BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

Das Anlageziel der einzelnen Fonds ist die Erzielung laufender Erträge und einer angemessenen Liquidität bei gleichzeitig niedriger Volatilität des Kapitals durch die Verwaltung eines Portfolios von qualitativ hochwertigen Geldmarktinstrumenten und festverzinslichen Instrumenten, darunter zinsvariable Wertpapiere. Für weitere Einzelheiten zu der Anlagepolitik eines jeden der oben genannten Fonds werden die Anleger auf den Prospekt verwiesen.

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

Das Anlageziel des Fonds ist die Maximierung der laufenden Erträge bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und einer angemessenen Liquidität durch die Verwaltung eines Portfolios von qualitativ hochwertigen kurz- bis mittelfristigen festverzinslichen Instrumenten, darunter Geldmarkt- und zinsvariable Wertpapiere. Für weitere Einzelheiten zu der Anlagepolitik des oben genannten Fonds werden die Anleger auf den Prospekt verwiesen.

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 nachhaltigkeitsbezogenen Angaben im Jahresbericht.

Die diesem Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. 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 Fonds nicht, sofern im Prospekt nicht anders angegeben, PAIs bei der Auswahl ihrer Anlagen zu berücksichtigen.

Name des Fonds	Performanceindikator	Ansatz zum Investmentmanagement	SFDR-Kriterien
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund ¹	ICE BofAML EUR 3-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index	Aktiv	Sonstige
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund ¹	€STR Overnight	Aktiv	Sonstige
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ¹	€STR Overnight	Aktiv	Artikel 8
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund ¹	€STR Overnight	Aktiv	Artikel 8
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund ¹	3-Month compounded €STR rückwirkend	Aktiv	Artikel 8
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund ¹	SONIA Overnight	Aktiv	Sonstige
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund ¹	SONIA Overnight	Aktiv	Artikel 8
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund ¹	SONIA Overnight	Aktiv	Artikel 8
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund ¹	3-Month compounded SONIA rückwirkend	Aktiv	Artikel 8
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund ¹	SOFR Overnight	Aktiv	Artikel 8
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund ¹	SOFR Overnight	Aktiv	Artikel 8

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Name des Fonds	Performanceindikator	Ansatz zum Investmentmanagement	SFDR-Kriterien
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund ¹	3-Month compounded SOFR rückwirkend	Aktiv	Artikel 8
BlackRock ICS US Treasury Fund ¹	SOFR Overnight	Aktiv	Sonstige

¹ Der in vorstehender Tabelle enthaltene Performance-Indikator wird lediglich zu Referenzzwecken angegeben. Weitere Einzelheiten entnehmen Sie bitte dem Prospekt.

Zusammenfassung der Wertentwicklung

Die nachstehende Tabelle vergleicht die realisierte Performance des Fonds mit dem entsprechenden Performanceindikator im Geschäftsjahr zum 30. September 2022.

Weitere Informationen zu den verwendeten Berechnungsmethoden sind unten aufgeführt:

- Bei den aufgeführten Renditen handelt es sich um die Performance-Renditen für die primäre Anteilklasse des 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 Performance-Renditen für andere Anteilklassen können auf Anfrage zur Verfügung gestellt werden.
- Die Fondserträge stützen sich auf die Summe der täglichen Dividendensätze nach Abzug von Gebühren. 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 Gesamtkostenquote („TER“) stellt die Summe aller Gebühren, Betriebskosten und Aufwendungen (mit Ausnahme direkter Handelskosten) dar, die dem Vermögen der einzelnen Fonds als Prozentsatz des durchschnittlichen Vermögens auf Basis des Zwölfmonatszeitraums zum 30. September 2022 belastet wird.

Name des Fonds	Fondsrendite %	Performanceindikator %	TER %
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund			
- Accumulating Shares	(0,40)	(0,47)	0,05
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund			
- Core (Acc) Shares	(0,62)	(0,46)	0,04
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund			
- Core (Acc) Shares	(0,44)	(0,48)	0,15
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund			
- Core (Acc) Shares	(0,45)	(0,48)	0,15
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund			
- Core Shares	(0,50)	(0,47)	0,20
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund			
- Core (Acc) Shares	0,64	0,72	0,15
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund			
- Core (Dis) Shares	0,72	0,70	0,18
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund			
- Core (Acc) Shares	0,72	0,70	0,16
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund			
- Core Shares	0,47	0,70	0,20
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund			
- Core (Dis) Shares	0,83	0,74	0,16
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund			
- Core (Acc) Shares	0,85	0,74	0,18
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund			
- Select Shares	0,86	0,76	0,15
BlackRock ICS US Treasury Fund			
- Core (Acc) Shares	0,72	0,76	0,13

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. 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 KIID, ein wesentlicher Bestandteil desselben sind. Exemplare davon sind bei Investor Services, der Transferstelle, der Verwaltungsgesellschaft oder einem der Vertreter oder einer der Vertriebsgesellschaften erhältlich.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

Globaler Wirtschaftsüberblick

Vor dem Hintergrund eines nachlassenden Konjunkturaufschwungs gerieten sowohl Anleihen als auch Aktien durch die hartnäckig hohe Inflation (Anstieg der Preise für Waren und Dienstleistungen) und die Tendenzen zu einer Straffung der Geldpolitik seitens der größten Zentralbanken weltweit unter Druck. Der Einmarsch Russlands in der Ukraine im Februar 2022 führte zu weiteren Unsicherheiten und Störungen auf den Finanzmärkten. Die gegen Russland verhängten Sanktionen wirkten sich negativ auf Unternehmen mit Verbindungen in die Region aus und trugen zu kräftiger Volatilität (Marktschwankungen) mancher Rohstoffpreise bei.

Angetrieben durch einen sprunghaften Anstieg der Konsumausgaben und den auflebenden internationalen Handel, verzeichnete die US-Wirtschaft im letzten Quartal des Jahres 2021 ein rasantes Wachstum. Doch angesichts eines zunehmenden Handelsdefizits und schwindender Unternehmensinvestitionen verringerte sich das US-amerikanische Bruttoinlandsprodukt im ersten Halbjahr 2022, was bei Anlegern Rezessionsängste weckte. Die japanische Wirtschaft wuchs moderat, beflügelt durch die Aufhebung der COVID-19-bedingten Einschränkungen und höhere Staatsausgaben. Das britische Wirtschaftswachstum kühlte ab, als das produzierende und die verarbeitende Industrie schwächelten. Dem stetigen Wachstum in der Eurozone lagen der private Konsum und der Reiseverkehr bei gelockerten COVID-19-Auflagen zugrunde.

Die Volkswirtschaften von Schwellenländern zeigten sich volatil, da schwankende Rohstoffpreise und abweichende Zentralbankpolitik zu maßgeblichen Wachstumsunterschieden führten. Die chinesische Wirtschaft bremste im zweiten Quartal 2022 angesichts aufsichtsrechtlicher Eingriffe, Sorgen um den hochverschuldeten Immobiliensektor und neuerlicher COVID-19-bedingter Lockdowns in der zweiten Jahreshälfte 2022 kräftig ab. Indiens Wirtschaft wuchs auf Jahresbasis zügig, was teilweise auf die Stärke des Dienstleistungssektors zurückzuführen ist.

Während sich die Weltwirtschaft weiter von den Folgen der COVID-19-Pandemie erholte und die Inflation anzog, setzten die größten Zentralbanken der Welt allmählich verschiedene Maßnahmen zur Straffung der Geldpolitik um. Die US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“) erhöhte die Zinsen fünfmal, um die Inflation unter Kontrolle zu bringen. Unter anderem wurden sie im Juni, Juli und September 2022 in drei Schritten um jeweils 75 Basispunkte heraufgesetzt. Außerdem beendete die Fed ihre Anleihenkaufprogramme und begann im Juni 2022 mit dem Abbau eines Teils der von ihr erworbenen Anleihen.

Die Bank of England („BoE“) erhöhte die Zinssätze sieben Mal, da die Inflation den höchsten Stand seit vierzig Jahren erreichte. Auch in der Eurozone stiegen die Inflationsraten schneller an. Die Europäische Zentralbank („EZB“) erhöhte zweimal die Zinsen. Überdies signalisierte die EZB, sie werde Maßnahmen ergreifen, um eine stärkere Abweichung zwischen den Anleiherenditen (die sich entgegengesetzt zu den Kursen entwickeln) von Staaten der Eurozone zu verhindern, wenn die Zinsen steigen.

Die (sich gegenläufig zu den Kursen entwickelnden) Renditen der 10-jährigen US-Staatsanleihe, ein Referenzzins für den globalen Rentenmarkt, erhöhten sich im Berichtszeitraum, da die Zentralbanken die Geldpolitik anzogen. Die Renditekurve, die die Differenz zwischen den Renditen verschiedener Laufzeiten misst, kehrte sich um, was ein Zeichen dafür ist, dass die Märkte zunehmend über eine Verlangsamung des Wirtschaftswachstums besorgt waren. Die Renditen britischer Staatsanleihen legten spürbar zu, da die im Berichtszeitraum angedachten Steuersenkungen die Wahrscheinlichkeit erhöhten, dass der Staat mehr Kapital aufnehmen muss. Die BoE griff ein, um bei erheblicher Volatilität zusätzliche Liquidität zur Verfügung zu stellen und so den Markt für britische Staatsanleihen zu stabilisieren. Auch europäische Staatsanleihen tendierten im sechsmonatigen Berichtszeitraum sichtlich abwärts, während sich der Rückgang bei japanischen Staatsanleihen langsamer vollzog. Auch die Renditen der meisten anderen Staatsanleihen tendierten stärker, insbesondere die der europäischen Staatsanleihen. Japanische Staatsanleihen verzeichneten dagegen einen langsameren Anstieg der Renditen.

Unternehmensanleihen verbuchten weltweit negative Erträge, da die Renditen deutlich anzogen. Bei wachsender Inflationsangst hoben die meisten maßgeblichen Zentralbanken weltweit die Zinsen an und minderten damit den Wert umlaufender Anleihen. Die Kurse von Unternehmensanleihen gaben weltweit nach, da sich die Renditespreads (der Renditeabstand zwischen Staats- und Unternehmensanleihen mit ähnlichen Laufzeiten) weiteten und die Anleger die Konditionen von Unternehmensanleihen bei gesteigerter Unsicherheit anders bewerteten.

Schwellenländeraktien verbuchten einen erheblichen Rückgang, da der US-Dollar stärker wurde und die Zinsen stiegen. In mehreren Schwellenländern wie z. B. Indien, Brasilien und Mexiko erhöhten die Zentralbanken wiederholt die Zinssätze als Reaktion auf die gestiegenen Inflations Sorgen. Die Kurse von Schwellenländeranleihen gaben abrupt nach, insbesondere nach dem Einmarsch Russlands in der Ukraine Ende Februar 2022.

Der Rohstoffmarkt zeigte sich volatil. Die Preise zogen nach dem russischen Einmarsch in der Ukraine zunächst kräftig an und gaben dann aufgrund von Wachstumssorgen wieder leicht nach. Rohöl der Sorte Brent legte zu, da sich die Nachfrage erholte. In Europa stiegen die Erdgaspreise aufgrund von Lieferunterbrechungen aus Russland kräftig an. Die Goldpreise gaben aufgrund höherer Zinssätze nach, was unverzinsliche Anlagen trotz steigender Inflationsraten im Vergleich weniger attraktiv erscheinen ließ.

An den Devisenmärkten stieg der US-Dollar gegenüber den meisten anderen Weltwährungen an, insbesondere als die Fed im Jahr 2022 begann, ihre Geldpolitik zu straffen. Der japanische Yen fiel gegenüber dem US-Dollar auf den niedrigsten Stand seit 24 Jahren, da die Inflation in Japan im Vergleich zu anderen Märkten relativ verhalten blieb, was die Bank of Japan dazu veranlasste, die Zinsen niedrig zu halten. Auch der Euro, das Pfund Sterling und der chinesische Yuan verloren im Verhältnis zum US-Dollar, da die Anleger den US-Dollar als vor geopolitischen Turbulenzen besser abgeschottet ansahen.

Überblick über die Fonds-Performance und die Veränderungen im Portfolio

BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,40 % und lag damit über seinem Performanceindikator, der (0,47 %) verbuchte.

Wir haben einen vorsichtigen Ansatz gewählt und die Duration in diesem Zinserhöhungszyklus sehr kurz gehalten. Wir streben eine tägliche Liquidität von etwa 3 % an und suchen weiterhin nach kurzen A2/P2-Emittenten am vorderen Ende der Kurve.

An den lokalen kanadischen Märkten bleiben wir ebenfalls weiterhin aktiv und kaufen kanadische Vermögenswerte, die vollständig in Euro abgesichert sind und einen Aufschlag gegenüber direkten in Euro denominierten Emissionen bieten. Dies ermöglicht es uns, das Universum zu vergrößern, da es den Einkauf zusätzlicher Kredite ermöglichte, die nicht direkt auf Euro lauteten.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Sonstige Commercial Paper	41,75 %	Sonstige Papiere	59,29 %
Sonstige Papiere	34,16 %	Sonstige Commercial Paper	18,33 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	15,76 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	13,70 %
Einlagenzertifikat	7,09 %	Einlagenzertifikat	7,18 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	1,25 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	1,30 %
		Investmentgesellschaft	0,17 %
		Sonstige	0,03 %

BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds (0,62 %) und lag damit unter seinem Performanceindikator, der (0,46 %) verbuchte.

Angesichts des wachsenden Preisdrucks in der Eurozone setzte die EZB die Zinsen im Juli um 50 Basispunkte herauf, nachdem sie sie seit Jahresbeginn unangetastet gelassen hatte. Damit stellte sie die Markterwartungen in den Schatten: Der Markt hatte im Vorfeld der Sitzung lediglich die 50 %ige Wahrscheinlichkeit einer Erhöhung um 50 Basispunkte eingepreist. Mit dieser ersten Zinserhöhung seit elf Jahren endet die Zeit der Negativzinsen.

Die Inflation ist weiterhin hoch, im Jahresverlauf noch gestiegen und hartnäckiger, als es die Zentralbanken erwartet hatten. Der Preis für die Eindämmung der Inflation ist gebremstes Wachstum beziehungsweise eine Rezession, und die Zentralbanken scheinen zumindest vorerst gewillt, dieses Spiel mitzuspielen. Die makroökonomischen Daten verschlechtern sich rasch, und die zukunftsorientierten Wirtschaftsindikatoren deuten auf eine Rezession in Europa hin. Die Frage ist dabei offenbar nicht, ob eine Rezession eintritt, sondern vielmehr wann, und wie gravierend sie ausfällt. Der Fokus und die Reaktionsfunktion des Marktes richten sich weiter auf die Preisstabilität als wichtigstes Element des EZB-Mandats. Der Markt geht davon aus, dass die EZB die Geldpolitik künftig restriktiv gestalten muss. Der Hochpunkt im Straffungszyklus (Terminal Rate) dürfte dabei über dem neutralen Zinssatz liegen, um die Nachfrage zu dämpfen und die Inflation zu drücken.

Aufgrund besserer relativer Werteigenschaften bevorzugt der Fonds französische und deutsche Anleihen und Schatzwechsel sowie, um ein großzügiges Liquiditätsniveau zu halten, weiterhin Allokationen zu Overnight-Repogeschäften.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Treasury Debt	55,18 %	Treasury Debt	86,17 %
Sonstige Repogeschäfte	29,41 %	Government Agency-Repogeschäft	13,83 %
Government Agency-Repogeschäft	15,41 %		

BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,44 % und lag damit über seinem Performanceindikator, der (0,48 %) verbuchte.

Im Fonds lag der Schwerpunkt auf dem Abbau der Liquidität, die wir nach dem Jahresende aufgebaut hatten. Wir bevorzugten weiterhin das kurze Ende der Kurve, wobei wir uns hauptsächlich auf dreimonatige und kürzere Laufzeiten konzentrieren und nur in begrenztem Umfang auf sechs Monate hinaus investieren. Nachdem die Kurve bemerkenswert flach geblieben war, stiegen die europäischen Geldmarktsätze an.

Mit Blick auf den zweiten Teil des Berichtszeitraums bleiben wir vorsichtig, da sich der Markt weiterhin auf höhere Zinserwartungen einstellt und der Krieg in der Ukraine für zusätzliche Unsicherheiten sorgt. Wir konzentrierten unsere Anlagen auf kurzfristige Wertpapiere (die gewichtete durchschnittliche Laufzeit („WAM“) sank von 53 auf 30 Tage), und unsere tägliche und wöchentliche Liquidität blieb hoch.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	38,12 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	34,01 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	21,57 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	30,05 %
Einlagenzertifikat	20,94 %	Einlagenzertifikat	18,53 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	8,72 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	5,88 %
Sonstige Commercial Paper	5,47 %	Government Agency-Repogeschäft	4,81 %
Sonstige Papiere	3,11 %	Sonstige Papiere	4,25 %
Government Agency-Repogeschäft	2,07 %	Sonstige Commercial Paper	2,47 %

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,45 % und lag damit über seinem Performanceindikator, der (0,48 %) verbuchte.

Im Fonds lag der Schwerpunkt auf dem Abbau der Liquidität, die wir nach dem Jahresende aufgebaut hatten. Wir bevorzugten weiterhin das kurze Ende der Kurve, wobei wir uns hauptsächlich auf dreimonatige und kürzere Laufzeiten konzentrieren und nur in begrenztem Umfang auf sechs Monate hinaus investieren. Nachdem die Kurve bemerkenswert flach geblieben war, stiegen die europäischen Geldmarktsätze an.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund (Fortsetzung)

Im zweiten Teil des Berichtszeitraums blieben wir vorsichtig, da sich der Markt weiterhin auf höhere Zinserwartungen einstellt und der Krieg in der Ukraine sowie die Ausschläge der Energiepreise für zusätzliche Unsicherheiten sorgen. Wir konzentrierten unsere Anlagen auf kurzfristige Wertpapiere (die WAM sank von 51 auf 30 Tage), und unsere tägliche und wöchentliche Liquidität blieb hoch.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Commercial Paper von Finanzunternehmen	29,12 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	32,64 %
Einlagenzertifikat	28,51 %	Einlagenzertifikat	26,78 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	12,44 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	11,66 %
Government Agency-Repogeschäft	10,12 %	Government Agency-Repogeschäft	10,50 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	8,50 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	7,74 %
Sonstige Commercial Paper	5,65 %	Treasury Debt	4,29 %
Sonstige Papiere	2,94 %	Sonstige Papiere	3,91 %
Treasury Debt	2,73 %	Sonstige Commercial Paper	2,49 %

BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds (0,50 %) und lag damit unter seinem Performanceindikator, der (0,47 %) verbuchte.

Im Laufe des Jahres hat die Verwaltungsgesellschaft die tägliche Liquidität zwischen 15 % und 20 % gehalten. Die Strategie sucht weiterhin nach Short-A2/P2-Emittenten am vordersten Ende der Kurve. Die Verwaltungsgesellschaft agiert weiterhin aktiv am lokalen kanadischen Markt und kauft kanadische Vermögenswerte, die vollständig in Euro abgesichert sind und einen Aufschlag gegenüber direkten in Euro denominierten Emissionen bieten. Dies ermöglicht es uns, das Universum, in das investiert wird zu vergrößern, da es den Einkauf zusätzlicher Kredite ermöglichte, die nicht direkt auf Euro lauteten. Die Verwaltungsgesellschaft fügte außerdem einige variabel verzinsliche Anleihen hinzu, die im Falle einer Zinserhöhung eine Renditesicherung bieten, da der Kupon alle 3 Monate zurückgesetzt wird.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Sonstige Commercial Paper	32,85 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	31,98 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	31,91 %	Sonstige Papiere	25,69 %
Sonstige Papiere	18,43 %	Einlagenzertifikat	21,70 %
Einlagenzertifikat	8,23 %	Sonstige Commercial Paper	8,58 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	4,32 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	6,19 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	4,22 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	3,97 %
Investmentgesellschaft	0,02 %	Investmentgesellschaft	1,89 %
Treasury Debt	0,05 %	Sonstige	0,00 %

BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,64 % und lag damit unter seinem Performanceindikator, der 0,72 % verbuchte.

Die BoE, die erste große Bank aus einem Industrieland, die den aktuellen Zinserhöhungszyklus einleitete, setzte ihre Zinserhöhungen fort. Auf ihrer Septembersitzung erhöhte die BoE den Zinssatz um 50 Basispunkte auf 2,25 %, was weniger war, als einige Marktteilnehmer erwartet hatten. Der Markt reagierte daraufhin mit einem Rückgang der Renditen am vorderen Kurvenende um 10 bis 15 Basispunkte.

Der neue Minihaushalt der Regierung wurde als ein ernsthaftes Problem der fiskalischen Glaubwürdigkeit angesehen und führte gegen Ende des dritten Quartals zu einer enormen Volatilität am Sterling-Markt. Die 1-jährige Sonia-Rendite sprang innerhalb von 2 Tagen um 135 Basispunkte nach oben. Die BoE musste intervenieren, um den Markt zu beruhigen und kaufte Gilts.

Der expansive Haushalt der Regierung in einem Umfeld, in dem sich die Inflation zweistelligen Zahlen nähert, warf nicht nur die Frage nach der finanzpolitischen Glaubwürdigkeit der Regierung auf, sondern auch die Frage, wie stark die BoE die Geldpolitik zusätzlich straffen müsste, um die Inflation wieder auf das Zielniveau zu senken. Ende September hatte die Sonia-Kurve eine Zinserhöhung um 140 Basispunkte für November eingepreist, gefolgt von weiteren 100 Basispunkten im Dezember. Der Hochpunkt im Straffungszyklus (Terminal Rate), den der Markt sah, hat sich nach dem Minihaushalt deutlich nach oben bewegt und liegt nun bei 6 % für Mitte 2023.

Im Laufe des Jahres steigen die Geldmarktrenditen, wobei die indikativen 3-Monats-, 6-Monats- und 1-Jahres-Renditen um 261 Basispunkte, 357 Basispunkte bzw. 310 Basispunkte steigen.

Das britische Debt Management Office („DMO“) kündigte eine Erhöhung des Nettofinanzierungsbedarfs für 2022-23 um 72,4 Mrd. GBP auf 234,1 Mrd. GBP an, die 62,4 Mrd. GBP an zusätzlichen Gilt-Verkäufen umfasst. Wir sind weiterhin der Ansicht, dass Treasury-Repogeschäfte im Vergleich zu Treasury-Schuldtiteln den besten relativen Wert bieten, und die WAM des Fonds liegt weiterhin um die 8 Tage.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Treasury-Repogeschäft	61,54 %	Treasury Debt	44,97 %
Government Agency-Repogeschäft	24,41 %	Treasury-Repogeschäft	44,20 %
Treasury Debt	14,05 %	Government Agency-Repogeschäft	10,83 %

BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,72 % und lag damit über seinem Performanceindikator, der 0,70 % verbuchte.

Während des Berichtszeitraums war eine der wichtigsten Antriebskräfte für die Strategie der Druck zum Jahresende, der die Verfügbarkeit von Emissionen stark beeinflusste. Die Verwaltungsgesellschaft konzentrierte sich darauf, auf kurzfristige Kredite zuzugreifen und zum Jahreswechsel die Barmittel auszugeben. Ein weiterer Schwerpunkt war die Erwartung von Zinserhöhungen, aufgrund der die Verwaltungsgesellschaft zögerte, die Duration bei festverzinslichen Wertpapieren zu stark zu erhöhen. Hinzu kam die Invasion in der Ukraine, und die zunehmenden Unsicherheiten veranlassten die Verwaltungsgesellschaft, die WAM von 52 auf 31 Tage zu reduzieren.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	30,57 %	Einlagenzertifikat	38,30 %
Einlagenzertifikat	29,07 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	22,10 %
Sonstige Papiere	10,47 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	21,35 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	8,78 %	Treasury-Repogeschäft	7,92 %
Treasury-Repogeschäft	8,14 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	5,15 %
Government Agency-Repogeschäft	4,80 %	Government Agency-Repogeschäft	2,96 %
Sonstige Commercial Paper	4,58 %	Sonstige Papiere	1,13 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	3,59 %	Sonstige Commercial Paper	1,09 %

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,72 % und lag damit über seinem Performanceindikator, der 0,70 % verbuchte.

Nach den Zinserhöhungen und der marktweiten Einpreisung weiterer Zinserhöhungen bei den nächsten Sitzungen des geldpolitischen Ausschusses haben wir einen vorsichtigen Ansatz gewählt. Wir hielten die Zahlungsmittel kurz und strebten über 50 % an wöchentlicher Liquidität an. Unser Fokus lag auf kurzen festverzinslichen Anlagen (unter 1 Monat), und wir fügten variabel verzinsliche Papiere mit einer Laufzeit von 1 Jahr hinzu. Nachdem wir unsere WAM leicht auf 40 Tage erhöht hatten, lag sie am Ende des Quartals wieder im niedrigen bis mittleren 30-Tage-Bereich.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Einlagenzertifikat	38,55 %	Einlagenzertifikat	44,33 %
Sonstige Papiere	14,74 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	25,57 %
Treasury-Repogeschäft	14,73 %	Treasury-Repogeschäft	13,87 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	14,24 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	9,86 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	8,52 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	2,85 %
Government Agency-Repogeschäft	3,43 %	Sonstige Papiere	1,82 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	3,02 %	Treasury Debt	1,33 %
Sonstige Commercial Paper	2,32 %	Government Agency-Repogeschäft	0,35 %
Treasury Debt	0,45 %		

BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,47 % und lag damit unter seinem Performanceindikator, der 0,70 % verbuchte.

Die Verwaltungsgesellschaft zögerte angesichts des Risikos weiterer Zinsbewegungen und des unsicheren wirtschaftlichen Umfelds, mit einer Verlängerung der Duration und erhöhte das Risiko im Portfolio daher nur gering.

Die Verwaltungsgesellschaft verfolgte weiterhin einen vorsichtigen Ansatz, hielt die tägliche Liquidität bei etwa 20 % und konzentrierte die Investments auf Wertpapiere mit kurzer Laufzeit. Die Verwaltungsgesellschaft ist bestrebt, durch Anlagen in kurzlaufende A2/P2-Emittenten einen Mehrwert zu schaffen, und bleibt im Handel mit Euro, US-Dollar und kanadischen Dollar aktiv, indem sie diese in Pfund Sterling abgesicherten Vermögenswerte kauft und eine gute Prämie gegenüber GBP-Emittenten bietet, um zusätzlichen Kredite nicht direkt zu helfen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Einlagenzertifikat	29,83 %	Sonstige Papiere	27,06 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	24,41 %	Einlagenzertifikat	25,67 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	16,77 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	14,17 %
Sonstige Commercial Paper	11,78 %	Sonstige Commercial Paper	11,76 %
Sonstige Papiere	7,86 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	10,38 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	5,32 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	6,54 %
Investmentgesellschaft	4,02 %	Investmentgesellschaft	4,58 %

BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,83 % und lag damit über seinem Performanceindikator, der 0,74 % verbuchte.

Vor diesem Hintergrund war eine defensive Anlagestrategie angemessen: Die Präferenz für eine höhere Liquidität und kürzer datierte Anlagen versetzte den Fonds in die Lage, den Anstieg der Anlagerenditen zu nutzen und gleichzeitig den Kapitalerhalt im Auge zu behalten. Im Großen und Ganzen streben wir weiterhin eine kürzere Duration mit einer WAM von etwa 20 bis 25 Tagen an, wobei wir uns auf qualitativ höherwertige Wertpapiere und selektive variabel verzinsliche Anlagen konzentrieren, die in diesem Umfeld der Zinsvolatilität Schutz bieten.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Commercial Paper von Finanzunternehmen	28,45 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	34,57 %
Einlagenzertifikat	27,65 %	Einlagenzertifikat	26,79 %
Government Agency-Repogeschäft	22,30 %	Government Agency-Repogeschäft	11,36 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	12,47 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	10,19 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	5,43 %	Sonstige Commercial Paper	9,37 %
Sonstige Commercial Paper	2,99 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	5,70 %
Treasury-Repogeschäft	0,49 %	Sonstige Papiere	1,51 %
Sonstige Papiere	0,21 %	Treasury-Repogeschäft	0,50 %

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,85 % und lag damit über seinem Performanceindikator, der 0,74 % verbuchte.

Die Mitglieder des Offenmarktausschusses („FOMC“) stimmten für eine Anhebung des Leitzinses. Im Gegensatz zu den vorangegangenen Sitzungen, die mit Erhöhungen von 25 Basispunkten bzw. 50 Basispunkten abgeschlossen wurden, hat der Ausschuss die Spanne des Leitzinses dreimal um je 75 Basispunkte erhöht. Die Leitzinsspanne der Fed liegt nun bei 3,00 % bis 3,25 %.

Da sich die Medianprojektion für den Leitzins in den Jahren 2022 und 2023 auf 4,4 % bzw. 4,6 % erhöht hat, stiegen die Geldmarktrenditen im Laufe des Jahres stark an und zeigten eine steilere Tendenz, da die einjährigen Renditen zum ersten Mal seit 2007 die 5 %-Marke erreichten.

Für den 3-Monats-, 6-Monats- bzw. 12-Monatszeitraum stiegen die indikativen Werte im Jahresverlauf um 316 Basispunkte, 375 Basispunkte und 412 Basispunkte .

Vor diesem Hintergrund war eine defensive Anlagestrategie angemessen: Die Präferenz für eine höhere Liquidität und kürzer datierte Anlagen versetzte den Fonds in die Lage, den Anstieg der Anlagerenditen zu nutzen und gleichzeitig den Kapitalerhalt im Auge zu behalten. Im Großen und Ganzen streben wir weiterhin eine kürzere Duration mit einer WAM von etwa 20 bis 25 Tagen an, wobei wir uns auf qualitativ höherwertige Wertpapiere und selektive variabel verzinsliche Anlagen konzentrieren, die in diesem Umfeld der Zinsvolatilität Schutz bieten.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Einlagenzertifikat	31,31 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	34,97 %
Commercial Paper von Finanzunternehmen	26,39 %	Einlagenzertifikat	30,02 %
Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	15,66 %	Sonstige Instrumente (Termineinlagen)	17,29 %
Government Agency-Repogeschäft	13,75 %	Treasury-Repogeschäft	6,09 %
Treasury-Repogeschäft	5,59 %	Sonstige Commercial Paper	5,92 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	3,68 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	2,40 %
Sonstige Commercial Paper	3,32 %	Government Agency-Repogeschäft	2,09 %
Sonstige Papiere	0,30 %	Sonstige Papiere	1,22 %

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,86 % und lag damit unter seinem Performanceindikator, der 0,76 % verbuchte.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES INVESTMENTMANAGERS (Fortsetzung)

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

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung)

Vor diesem Hintergrund ist eine defensive Anlagestrategie weiterhin angemessen: Die Präferenz für eine höhere Liquidität und kürzer datierte Anlagen versetzte den Fonds in die Lage, den Anstieg der Anlagerenditen zu nutzen und gleichzeitig den Kapitalerhalt im Auge zu behalten. Die Verwaltungsgesellschaft ist in diesem Umfeld bei ihrer defensiven Anlagestrategie geblieben, wobei sie auch eine Tendenz zu kürzerfristigen Anlagen beibehielt. Zur gleichen Zeit wurde das Rendite-Carry durch diversifizierte Anlagen in Commercial Paper optimiert. Gleichzeitig blieb die Strategie bei ihrer selektiven Auswahl von längerfristigen variabel verzinslichen Wertpapieren. Sie können in einem Umfeld steigender Zinssätze Schutz bieten.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Commercial Paper von Finanzunternehmen	33,23 %	Einlagezertifikat	32,53 %
Sonstige Commercial Paper	28,51 %	Commercial Paper von Finanzunternehmen	25,60 %
Einlagezertifikat	24,31 %	Sonstige Commercial Paper	25,22 %
Investmentgesellschaft	4,51 %	Sonstige Papiere	7,37 %
Sonstige Papiere	3,58 %	Investmentgesellschaft	4,93 %
Forderungsbesicherte Commercial Paper	2,88 %	Forderungsbesicherte Commercial Paper	2,01 %
Sonstige	2,64 %	Sonstige Kommunalschuldverschreibungen	1,04 %
Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften	0,32 %	Finanzierungsvereinbarung von Versicherungsgesellschaften	0,45 %
Sonstige Kommunalschuldverschreibungen	0,01 %	Treasury Debt	0,44 %
		Sonstige	0,43 %

BlackRock ICS US Treasury Fund

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 betrug die Rendite des Fonds 0,72 % und lag damit unter seinem Performanceindikator, der 0,76 % verbuchte.

Da die Anlagerenditen aufgrund der anhaltend aggressiven Rhetorik des Ausschusses gestiegen sind, haben die Portfoliomanager die Allokation der Vermögenswerte im Portfolio taktisch angepasst. Der prozentuale Anteil der Vermögenswerte, der auf US-Schatzwechsel entfiel, wurde von 34,49 % im vorangegangenen Berichtszeitraum auf 41,85 % zum Ende des aktuellen Berichtszeitraums erhöht. Umgekehrt wurde der Anteil der Vermögenswerte, der auf Repogeschäfte entfiel, von 65,51 % im vorangegangenen Berichtszeitraum auf 58,15 % zum Ende des aktuellen Berichtszeitraums erhöht.

Angesichts der Erwartung, dass die Volatilität recht hoch bleiben wird und das Wertversprechen einer weiteren Durationsverlängerung schwindet, gehen die Portfoliomanager davon aus, dass sie das Durationsprofil in nächster Zeit relativ statisch halten werden.

In der folgenden Tabelle werden die bedeutenden Portfoliogewichtungen zum 30. September 2022 und 30. September 2021 angegeben:

30. September 2022		30. September 2021	
Wertpapier	Gewichtung	Wertpapier	Gewichtung
Treasury-Repogeschäft	58,15 %	Treasury-Repogeschäft	65,51 %
Treasury Debt	41,85 %	Treasury Debt	34,49 %

BlackRock Investment Management (UK) Limited
BlackRock Capital Management, Inc.
Oktober 2022

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

CORPORATE-GOVERNANCE-ERKLÄRUNG

Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) der Institutional Cash Series plc (die „Gesellschaft“) hat sich der Aufrechterhaltung der höchsten Corporate-Governance-Standards verpflichtet und zeichnet gegenüber den Anteilhabern für die Unternehmensführung der Gesellschaft verantwortlich. Der Verwaltungsrat hat ein Corporate-Governance-Rahmenwerk eingeführt, das er in Bezug auf Investmentfonds für angemessen hält und das es der Gesellschaft ermöglichen wird, die betreffenden Bestimmungen des Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies (Corporate Governance-Kodex für Investmentfonds und Verwaltungsgesellschaften) der Irish Funds Industry Association (der „Code“), der zum 1. Januar 2012 in Kraft trat, einzuhalten. Dieser Code ist zugänglich auf: <https://www.irishfunds.ie/regulatory-technical/corporate-governance>.

Die Gesellschaft hat diesen Code freiwillig übernommen, und der Code wird von der Gesellschaft auf sämtliche Rechnungslegungszeiträume ab dem 1. Januar angewandt. 2012.

Der Verwaltungsrat ist der Ansicht, dass die Gesellschaft sämtliche Bestimmungen des IFIA-Code während dieses Rechnungslegungszeitraums eingehalten hat.

Die Gesellschaft unterliegt ferner Corporate-Governance-Praktiken, die vorgeschrieben werden durch:

(i) Den Companies Act von 2014, abzurufen ist unter <http://www.irishstatutebook.ie/home.html>;

(ii) Die Satzung der Gesellschaft, die am eingetragenen Sitz der Gesellschaft zur Einsichtnahme zur Verfügung steht; und

(iii) Die Zentralbank in ihren OGAW-Vorschriften und Leitlinien, die auf der Website der Zentralbank unter: <http://www.centralbank.ie> abrufbar sind.

Der Verwaltungsrat ist zuständig für die Einrichtung und Aufrechterhaltung angemessener interner Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Gesellschaft in Bezug auf den Prozess der Finanzberichterstattung. Solche Systeme sind eher dafür konzipiert, das Risiko, dass die Ziele der Finanzberichterstattung der Gesellschaft nicht erreicht werden, zu steuern, nicht dafür, es komplett auszuschalten. Die Gesellschaft setzt Verfahren ein, um zu gewährleisten, dass alle relevanten Geschäftsbücher ordnungsgemäß geführt werden und verfügbar sind, einschließlich der Aufstellung der Jahres- und Halbjahresabschlüsse. Diese Verfahren schließen die Bestellung des Fondsverwalters zur Führung der Geschäftsbücher der Gesellschaft unabhängig vom Investmentmanager und der Verwahrstelle ein. Die Jahres- und Halbjahresabschlüsse der Gesellschaft müssen vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt und bei der Zentralbank eingereicht werden. Die Abschlüsse werden gemäß geltendem irischem Recht und den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsmethoden aufgestellt. Die im Jahresbericht angegebenen Rechnungslegungsinformationen müssen geprüft werden. Der Bericht der Abschlussprüfer, einschließlich eventueller Einschränkungen, wird im Jahresbericht der Gesellschaft vollständig wiedergegeben.

Die Versammlungen der Anteilhaber unterliegen der Satzung der Gesellschaft und dem irischen Companies Act von 2014. Obwohl die Mitglieder des Verwaltungsrats jederzeit eine außerordentliche Hauptversammlung der Gesellschaft einberufen können, müssen die Mitglieder des Verwaltungsrats eine Jahreshauptversammlung der Gesellschaft innerhalb von 15 Monaten nach dem Datum der vorangegangenen Jahreshauptversammlung einberufen. Den Anteilhabern ist jede Jahreshauptversammlung und jede zur Fassung eines Sonderbeschlusses anberaumte Versammlung mit einer Frist von mindestens 21 Tagen anzukündigen und jede andere Hauptversammlung mit einer Frist von 14 Tagen, sofern die Abschlussprüfer der Gesellschaft und alle teilnahme- und abstimmungsberechtigten Anteilhaber der Gesellschaft keiner kürzeren Frist zugestimmt haben.

Zwei entweder persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter anwesende Gesellschafter stellen auf einer Hauptversammlung eine beschlussfähige Mehrheit dar. Jeder Anteilhaber, der persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter anwesend ist und per Handzeichen abstimmt, hat eine Stimme. Bei Abstimmungen mit Stimmzetteln hat jeder persönlich oder durch einen Stimmrechtsvertreter anwesende Anteilhaber für jeden von ihm gehaltenen Anteil eine Stimme. Der Vorsitzende der Hauptversammlung der Gesellschaft oder mindestens fünf persönlich oder durch einen Stimmrechtsvertreter anwesende Mitglieder oder jeder/alle persönlich oder durch einen Stimmrechtsvertreter anwesende(n) Anteilhaber, auf den/die mindestens ein Zehntel der gesamten Stimmrechte aller auf einer solchen Versammlung stimmberechtigten Anteilhaber entfallen, kann/können eine Abstimmung mit Stimmzetteln verlangen.

Nicola Grenham gilt insoweit als unabhängiges Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft, als sie gemäß Charakter und Urteilsvermögen als unabhängig erachtet werden kann und durch keinerlei Beziehungen oder Umstände verpflichtet ist, die das Urteilsvermögen eines Verwaltungsratsmitglieds (scheinbar) beeinflussen könnten. Sie ist unabhängig von der Verwaltungsgesellschaft, dem Investmentmanager sowie dritten Dienstleistungsanbietern wie dem Fondsverwalter und der Verwahrstelle.

Die Geschäfte der Gesellschaft werden vom Verwaltungsrat geführt, der mindestens vierteljährlich zusammenkommt. Der Verwaltungsrat delegiert bestimmte Funktionen an die Verwaltungsgesellschaft und die Verwahrstelle. Die Verwaltungsgesellschaft bestellt ihrerseits den Fondsverwalter (auf den bestimmte administrative Funktionen übertragen werden) und den Investmentmanager (an den die hauptsächlichen Distributions- und Investmentmanagementfunktionen delegiert werden). Ein Verwaltungsratsmitglied kann und der Secretary der Gesellschaft muss auf Verlangen eines Verwaltungsratsmitglieds jederzeit eine Versammlung des Verwaltungsrats einberufen. Bei einer Sitzung des Verwaltungsrats auftretende Fragen werden mit der Mehrheit der Stimmen entschieden. Bei Stimmgleichheit hat der Vorsitzende eine zweite oder ausschlaggebende Stimme. Die für die Durchführung von Geschäften auf einer Verwaltungsratssitzung erforderliche beschlussfähige Mehrheit ist zwei.

Der Verwaltungsrat hatte einen Prüfungsausschuss errichtet, der sich aus drei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern zusammensetzte. Der Prüfungsausschuss traf während des Berichtszeitraums zur Durchführung seiner Aufgaben zehn Mal zusammen und berichtete direkt an den Verwaltungsrat. Sämtliche Angelegenheiten, die dem Prüfungsausschuss vorgelegt wurden und die Einbeziehung oder eine Entscheidung des Verwaltungsrats erforderlich machten, wurden unmittelbar dem Verwaltungsrat vorgelegt. Nach der Umbildung des Verwaltungsrats hat selbiger beschlossen, dessen Prüfungsausschuss mit Wirkung vom 27. Juli 2022 auf der Grundlage aufzulösen, dass der Gesellschaft besser gedient ist, wenn die zuvor an den Prüfungsausschuss delegierten Aufgaben von allen Verwaltungsratsmitgliedern übernommen werden, einschließlich der Prüfung des Jahresabschlusses und damit verbundener Angelegenheiten im Namen der Gesellschaft.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

CORPORATE-GOVERNANCE-ERKLÄRUNG (Fortsetzung)

Diversitätsbericht

Der Verwaltungsrat erkennt an, dass Vielfalt wichtig ist, um operative Verbesserungen zu erreichen. Während des Auswahlprozesses verpflichtet sich der Verwaltungsrat, bei der Auswahl auf eine Vielfalt an unternehmerischen Fähigkeiten, Erfahrungen und Geschlechtern zu achten, und die zu ernennenden Kandidaten werden auf Grundlage dieser Merkmale berücksichtigt. Der Verwaltungsrat verfolgt den Grundsatz, dass jedes Verwaltungsratsmitglied über Fähigkeiten, Erfahrung, Wissen und eine generelle Eignung verfügen muss, die es jedem Verwaltungsratsmitglied erlauben, einzeln und als Teil des Verwaltungsrats zur Effizienz des Verwaltungsrats beizutragen. Vorbehaltlich des obersten Grundsatzes ist der Verwaltungsrat der Meinung, dass die Vielfalt von Erfahrung und Ansatz, u. a. der schulische und berufliche Hintergrund, das Geschlecht, Alter und die geografische Herkunft unter den Vorstandsmitgliedern im Hinblick auf die Ausgewogenheit im Verwaltungsrat insgesamt hohen Stellenwert haben, wenn neue Mitglieder in den Verwaltungsrat ernannt werden. Die Priorität des Verwaltungsrats liegt darin, sicherzustellen, dass er weiter über eine starke Führung und relevante Kompetenzen verfügt, um die Unternehmensstrategie umzusetzen. Die Implementierung der Vielfältigkeitsrichtlinie wird vom Verwaltungsrat überwacht, der das Gleichgewicht der Fähigkeiten, des Wissens, der Erfahrung und der Vielfalt im Verwaltungsrat prüft und für die Nachfolgeplanung für Ernennungen in den Verwaltungsrat zuständig ist. Der Verwaltungsrat wird sicherstellen, dass alle Auswahlentscheidungen auf Leistung basieren und dass das Einstellungsverfahren gerecht und nicht diskriminierend ist. Die Richtlinie des Verwaltungsrats besteht darin, dass mindestens 30 % der Posten des Verwaltungsrats mit Frauen besetzt sein sollen. Der Verwaltungsrat hat derzeit sechs Mitglieder, vier davon sind Frauen. Die aktuelle Zusammensetzung des Verwaltungsrats spiegelt verschiedene Alters-, Geschlechter-, Bildungs- und Berufshintergründe wider.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat legt seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 30. September 2022 beendete Geschäftsjahr vor.

Erklärung über die Obliegenheiten des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Erstellung des Jahresberichts und des Jahresabschlusses gemäß den anwendbaren irischen Gesetzen und den in Irland allgemein anerkannte Bilanzierungsgrundsätze („GAAP“), einschließlich der vom Financial Reporting Council herausgegebenen und vom Institute of Chartered Accountants in Irland veröffentlichten Rechnungslegungsstandards sowie in Einklang mit den Bestimmungen des irischen Companies Act von 2014 in der jeweils gültigen Fassung und den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften und Leitlinien“).

Nach irischem Gesellschaftsrecht ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Jahresabschluss zu erstellen, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Unternehmenslage für das betreffende Jahr vermittelt.

Bei der Erstellung dieser Abschlüsse ist der Verwaltungsrat 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 unter der Annahme der Unternehmensfortführung zu erstellen, es sei denn, die Annahme, dass das Unternehmen seine Geschäftstätigkeit fortführt, ist nicht angemessen.

Der Verwaltungsrat bestätigt, dass er bei der Erstellung des Jahresabschlusses die obigen Anforderungen erfüllt hat. Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, angemessene Geschäftsbücher zu führen, die ausreichen um:

- die Transaktionen des Unternehmens richtig aufzuzeichnen und zu erklären;
- zu ermöglichen, dass die Vermögens-, Finanz- und Ertragslage des Unternehmens jederzeit mit angemessener Genauigkeit bestimmt werden kann; und
- dem Verwaltungsrat zu ermöglichen, sicherzustellen, dass der Jahresabschluss den Companies Act von 2014 in der jeweils gültigen Fassung einhält, und zu ermöglichen, dass dieser Jahresabschluss geprüft werden kann.

In diesem Zusammenhang wurde J.P. Morgan Administration Services (Ireland) Limited für das Jahr mit der ordnungsgemäßen Führung der Geschäftsbücher und der Erstellung des Jahresabschlusses beauftragt. Dementsprechend werden die Geschäftsbücher an folgender Adresse geführt:

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

Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, das Vermögen der Gesellschaft zu sichern und angemessene Maßnahmen zur Verhütung und Aufdeckung von betrügerischen Handlungen und sonstigen Unregelmäßigkeiten zu treffen. Der Verwaltungsrat hat die Vermögenswerte der Gesellschaft der Verwahrstelle zur Verwahrung anvertraut. Der Verwaltungsrat hat diesbezüglich J.P. Morgan SE – Zweigniederlassung Dublin als Verwahrstelle bestellt. Deren Geschäftsadresse lautet wie folgt:

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

Die geprüften Abschlüsse werden auf der BlackRock-Website veröffentlicht. Der Verwaltungsrat ist gemeinsam mit der Verwaltungsgesellschaft und dem Investmentmanager für die Pflege und Integrität der auf dieser Website enthaltenen Finanzinformationen verantwortlich. Das Recht der Republik Irland, dem die Darstellung und Veröffentlichung des Abschlusses unterliegt, kann von dem in anderen Rechtssystemen geltenden Recht abweichen.

Ergebnisse und Dividenden

Die Ergebnisse und die Dividenden für das Geschäftsjahr der Gesellschaft sind in der Gewinn- und Verlustrechnung aufgeführt.

Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres

Die seit dem Bilanzstichtag eingetretenen wesentlichen Ereignisse sind in den Anmerkungen zum Jahresabschluss aufgeführt.

Beteiligungen und Geschäfte von Verwaltungsratsmitgliedern und Secretary

Die Verwaltungsratsmitglieder und der Secretary besaßen weder während noch am Ende des Geschäftsjahres Beteiligungen an den Anteilen des Unternehmens (2021: null).

Mit Wirkung vom 27. Juli 2022 wurden Nicola Grenham, Tom McGrath und Karen Prooth zu nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern bestellt. Paul McNaughton, Jessica Irschick, Paul McGowan, Roslyn O'Shea und Deirdre Somers traten am 27. Juli 2022 als nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder zurück. Becky Tilston Hales wurde mit Wirkung vom 17. September 2022 und Jacqueline Flynn mit Wirkung vom 22. September 2022 zu nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern ernannt.

Barry O' Dwyer, Jacqueline Flynn, Nicola Grenham, Becky Tilston Hales, Tom McGrath und Karen Prooth sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder. Jacqueline Flynn, Becky Tilston Hales, Tom McGrath und Karen Prooth sind außerdem Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe.

Kein Verwaltungsratsmitglied hatte zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahres eine wesentliche Beteiligung an einem Vertrag mit Signifikanz für die Geschäftstätigkeit des Unternehmens (2021: null).

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS (Fortsetzung)

Rückblick und zukünftige Entwicklungen

Die spezifischen Anlageziele und die Anlagepolitik für jeden Fonds, wie im Bericht des Investmentmanagers angegeben, werden vom Verwaltungsrat bei der Auflegung des Fonds formuliert. Anleger eines Fonds sollten sachkundige Anleger sein, die fachlichen Rat eingeholt haben und in der Lage sind, das Kapital- und Verlustrisiko zu tragen, und sollten eine Anlage in einen Fonds als mittel- bis langfristige Anlage betrachten. Eine Beschreibung des Fonds, dessen Performancerückblick und ein Marktrückblick sind dem Abschnitt „Hintergrund“ und dem „Bericht des Investmentmanagers“ zu entnehmen. Der Performancerückblick umfasst Angaben zum Tracking Error und zur Tracking-Differenz. Hierbei handelt es sich um wichtige Kennzahlen dazu, wie gut der Fonds verglichen mit seinen Referenzindizes verwaltet wurden.

Ein Bericht über die potenziellen Auswirkungen des Ausbruchs von COVID-19, die das Geschäft der Gesellschaft beeinträchtigen könnten, ist im Abschnitt „Hintergrund“ und in der Anmerkung zu finanziellen Risiken enthalten.

Risikomanagementziele und -strategien

Die Finanzinstrumente und Risiken, denen die Gesellschaft ausgesetzt ist, sind in den Anmerkungen zum Jahresabschluss aufgeführt. Die Corporate-Governance-Erklärung der Gesellschaft ist im Abschnitt Governance (Unternehmensführung) des Jahresabschlusses enthalten.

Unabhängige Abschlussprüfer

Die Abschlussprüfer, Ernst & Young, werden gemäß Section 383 des Companies Act von 2014 in der jeweils gültigen Fassung erneut bestellt.

Erklärung zu prüfungsrelevanten Informationen

Soweit den Verwaltungsratsmitgliedern bekannt ist, liegen keine prüfungsrelevanten Informationen vor, von denen die Abschlussprüfer des Unternehmens keine Kenntnis haben. Die Verwaltungsratsmitglieder haben alle Maßnahmen ergriffen, die sie als Verwaltungsratsmitglieder ergreifen sollten, um sich Kenntnis von prüfungsrelevanten Informationen zu verschaffen und sich zu vergewissern, dass den Abschlussprüfern des Unternehmens diese Informationen vorliegen.

Unternehmensfortführung

Der Jahresabschluss der Gesellschaft wurde unter der Annahme der Unternehmensfortführung (Going-Concern-Prinzip) erstellt. Die Gesellschaft ist in der Lage, alle seine Verbindlichkeiten aus seinen Vermögenswerten zu begleichen. Die Wertentwicklung, Börsengängigkeit und Risiken des Fonds werden im Laufe des Geschäftsjahres regelmäßig überprüft. Deshalb sind die Verwaltungsratsmitglieder der Auffassung, dass die Gesellschaft in absehbarer Zukunft den Geschäftsbetrieb aufrechterhalten kann und eine solide Finanzlage aufweist. Der Verwaltungsrat hat sich davon überzeugt, dass es zum Zeitpunkt der Genehmigung des Jahresabschlusses angemessen ist, den Jahresabschluss der Gesellschaft unter der Annahme der Unternehmensfortführung zu erstellen.

Entsprechenserklärung des Verwaltungsrats

Gemäß Section 225 des Companies Act von 2014 in der jeweils gültigen Fassung erkennen die Verwaltungsratsmitglieder an, dass sie dafür zuständig sind, sicherzustellen, dass die Gesellschaft seine jeweiligen Verpflichtungen erfüllt, und bestätigen, dass:

1. Eine Compliance-Richtlinie erarbeitet wurde, die (nach Auffassung des Verwaltungsrats für die Gesellschaft geeignete) Verfahren darlegt, die sicherstellen, dass die Gesellschaft seine jeweiligen Verpflichtungen erfüllt;
2. Es wurden angemessene Strukturen geschaffen, die nach Auffassung des Verwaltungsrats so konzipiert sind, dass sie sicherstellen, dass die Gesellschaft seine jeweiligen Verpflichtungen im Wesentlichen erfüllt; und
3. Es wurde ein jährliches Überprüfungsverfahren eingerichtet, um die entsprechende Verpflichtung der Gesellschaft zu überprüfen und sicherzustellen, dass Strukturen geschaffen wurden, damit diese Verpflichtungen erfüllt werden.

Für die Verwaltungsratsmitglieder

Verwaltungsratsmitglied

26. Januar 2023

Verwaltungsratsmitglied

26. Januar 2023

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER

Wir, die J.P. Morgan SE – Zweigniederlassung Dublin, ernannte Verwahrstelle für die Institutional Cash Series plc (das „Unternehmen“), legen diesen Bericht ausschließlich für die Anleger des Unternehmens als Gesamtheit für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 (die „Rechnungsperiode“) vor. Dieser Bericht wird in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften – die Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 (Durchführungsverordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) erstellt. 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 OGAW-Vorschriften festgelegten Pflichten als Verwahrstelle haben wir uns einen Überblick über die Geschäftstätigkeit des Unternehmens in der Rechnungsperiode verschafft und berichten den Anlegern des Fonds darüber.

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 OGAW-Vorschriften auferlegten Beschränkungen hinsichtlich der Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse des Unternehmens; und

(ii) auch ansonsten gemäß den Bestimmungen des Gründungsdokuments und der OGAW-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**

26. Januar 2023

BERICHT DER UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFER AN DIE ANTEILINHABER DER INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

Prüfvermerk

Wir haben den Abschluss der Institutional Cash Series plc (die „Gesellschaft“) für das am 30. September 2022 beendete Geschäftsjahr geprüft, der sich zusammensetzt aus der Gewinn- und Verlustrechnung, der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, der Bilanz, der Aufstellung der Vermögenswerte und den Anmerkungen zum Jahresabschluss, 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 der Gesellschaft zum 30. September 2022 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 Companies Act von 2014, der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und des Central Bank (Supervision and Enforcement Act) 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2015 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 der Gesellschaft 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.

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung

Bei der Prüfung des Abschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Verwendung des Grundsatzes der fortgeführten Geschäftstätigkeit durch den Verwaltungsrat 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 Gesellschaft 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 des Verwaltungsrats 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 Gesellschaft, die Geschäftstätigkeit fortzuführen.

BERICHT DER UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFER AN DIE ANTEILINHABER DER INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

Sonstige Angaben

Der Verwaltungsrat 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.

Beurteilungen sonstiger Sachverhalte, die gemäß des Companies Act von 2014 vorgeschrieben sind

Unserer Meinung nach – ausschließlich auf Basis unserer im Rahmen der Prüfung vorgenommenen Prüfungshandlungen – berichten wir Folgendes:

- die Informationen im Bericht des Verwaltungsrats für das abgeschlossene Geschäftsjahr, für das der Abschluss erstellt wurde, mit dem Abschluss übereinstimmen; und
- der Bericht des Verwaltungsrats in Übereinstimmung mit den anwendbaren gesetzlichen Vorschriften erstellt wurde.

Wir haben alle Informationen und Erklärungen eingeholt, die nach unserem besten Wissen und Gewissen für die Zwecke unserer Prüfung erforderlich sind.

Unserer Meinung nach waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um eine ordnungsgemäße Prüfung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, und der Jahresabschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.

Sachverhalte, zu denen wir ausnahmsweise Bericht erstatten müssen

Auf der Grundlage der im Zuge der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse und unseres Verständnisses von der Gesellschaft und ihrem Umfeld haben wir im Bericht des Verwaltungsrats keine wesentlichen Falschangaben festgestellt.

Gemäß dem Companies Act 2014 sind wir verpflichtet, Ihnen zu berichten, wenn die Gesellschaft unserer Meinung nach die in den Abschnitten 305 bis 312 des Gesetzes vorgeschriebenen Angaben nicht einhält. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

BERICHT DER UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFER AN DIE ANTEILINHABER DER INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

Jeweilige Aufgaben

Aufgaben des Verwaltungsrats im Zusammenhang mit dem Jahresabschluss

Wie in der Erklärung über Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats auf Seite 15 näher erläutert, ist der Verwaltungsrat 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. Er ist außerdem für die nach seiner 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 der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft zur Geschäftsführung zu beurteilen, gegebenenfalls Sachverhalte im Zusammenhang mit der Geschäftsführung anzugeben und bei der Bilanzierung von der Geschäftsführung auszugehen, sofern die Geschäftsführung weder beabsichtigt, die Gesellschaft zu liquidieren, noch den Betrieb einzustellen beziehungsweise dazu keine realistische Alternative hat.

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 (Ireland) 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 richtet sich ausschließlich an die Anteilhaber der Gesellschaft in ihrer Gesamtheit, in Übereinstimmung mit Section 391 des Companies Act von 2014. Unsere Prüfungsarbeit wurde so durchgeführt, dass wir den Anteilhabern der Gesellschaft diejenigen Fakten mitteilen konnten, 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 der Gesellschaft und den Anteilhabern der Gesellschaft als Gesamtheit.

Lisa Kealy
für und im Namen von
Ernst & Young Chartered Accountants and Statutory Audit

Firm Firmensitz: Dublin

Datum: 26. Januar 2023

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

		Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	Anm.	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
		Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Betriebliche Erträge	5	1.007.854	174.712	1.036	–	4	–	2.132	–
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	(29.808)	(5.029)	(1.617)	(91)	–	–	(2.253)	–
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		978.046	169.683	(581)	(91)	4	–	(121)	–
Betriebliche Aufwendungen	6	(146.661)	(114.063)	(431)	(142)	(19)	(76)	(2.851)	(2.003)
Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte		(199.373)	(278.127)	(2.465)	(1.114)	(307)	(589)	(26.467)	(24.120)
Betriebliche Nettoerträge/(-aufwendungen)		632.012	(222.507)	(3.477)	(1.347)	(322)	(665)	(29.439)	(26.123)
Finanzierungskosten:									
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	(6)	(673)	–	(27)	–	–	–	(4)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	(710.986)	(37.133)	–	–	–	–	–	–
Finanzierungskosten insgesamt		(710.992)	(37.806)	–	(27)	–	–	–	(4)
Nettogewinn/(-verlust)		(78.980)	(260.313)	(3.477)	(1.374)	(322)	(665)	(29.439)	(26.127)
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		(78.980)	(260.313)	(3.477)	(1.374)	(322)	(665)	(29.439)	(26.127)

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

		BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
		2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Anm.	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Betriebliche Erträge	5	14.836	–	5.483	–	18.974	2.198	57.803	3.976
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	413	85	(8.147)	(2.208)	–	–	(7.812)	(75)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		15.249	85	(2.664)	(2.208)	18.974	2.198	49.991	3.901
Betriebliche Aufwendungen	6	(27.630)	(27.104)	(4.132)	(3.557)	(2.057)	(895)	(3.869)	(1.545)
Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte		(185.022)	(227.549)	(19.339)	(20.644)	(163)	(1.486)	(123)	(1.520)
Betriebliche Nettoerträge/(-aufwendungen)		(197.403)	(254.568)	(26.135)	(26.409)	16.754	(183)	45.999	836
Finanzierungskosten:									
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	–	(84)	–	(654)	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	–	–	–	–	–	(5)	(33.490)	(772)
Finanzierungskosten insgesamt		–	(84)	–	(654)	–	(5)	(33.490)	(772)
Nettogewinn/(-verlust)		(197.403)	(254.652)	(26.135)	(27.063)	16.754	(188)	12.509	64
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		(197.403)	(254.652)	(26.135)	(27.063)	16.754	(188)	12.509	64

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

		BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
		2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Anm.	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Betriebliche Erträge	5	272.309	56.608	12.883	7.928	37.561	5.571	557.000	102.733
Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	5	(819)	(4.137)	(967)	(2.284)	(375)	(336)	196
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		272.314	55.789	8.746	6.961	35.277	5.196	556.664	102.929
Betriebliche Aufwendungen	6	(34.158)	(23.163)	(1.285)	(1.450)	(1.619)	(1.234)	(69.315)	(64.299)
Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte		(842)	(26.070)	(360)	(1.280)	–	(254)	–	–
Betriebliche Nettoerträge/(-aufwendungen)		237.314	6.556	7.101	4.231	33.658	3.708	487.349	38.630
Finanzierungskosten:									
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	(215.271)	(6.295)	(1.297)	(1.034)	(34.381)	(4.010)	(413.647)	(32.308)
Finanzierungskosten insgesamt		(215.271)	(6.295)	(1.297)	(1.034)	(34.381)	(4.010)	(413.647)	(32.308)
Nettogewinn/(-verlust)		22.043	261	5.804	3.197	(723)	(302)	73.702	6.322
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		22.043	261	5.804	3.197	(723)	(302)	73.702	6.322

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

		BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
		2022	2021	2022	2021
	Anm.	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Betriebliche Erträge	5	38.295	9.291	168.658	24.756
Nettogewinn/(-verluste) aus Finanzinstrumenten	7	(7.675)	(606)	7	(900)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		30.620	8.685	168.665	23.856
Betriebliche Aufwendungen	6	(2.701)	(2.255)	(23.154)	(12.009)
Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte		–	(2.688)	–	(8.730)
Betriebliche Nettoerträge/ (-aufwendungen)		27.919	3.742	145.511	3.117
Finanzierungskosten:					
Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen	8	(8)	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	9	(544)	(352)	(141.604)	(3.061)
Finanzierungskosten insgesamt		(552)	(352)	(141.604)	(3.061)
Nettogewinn/(-verlust)		27.367	3.390	3.907	56
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens		27.367	3.390	3.907	56

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	148.655.790	161.431.738	766.794	–	63.116	98.894	5.217.976	3.646.595
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	(78.980)	(260.313)	(3.477)	(1.374)	(322)	(665)	(29.439)	(26.127)
Geschäfte mit Anteilen:								
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen	980.677.642	803.789.540	51.043	770.568	27.035	103.623	53.056.973	42.164.748
Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	(973.440.446)	(811.310.276)	(13.352)	(2.400)	(50.417)	(138.736)	(53.334.324)	(40.567.240)
Wiederangelegte Dividende	259.027	21.302	–	–	–	–	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen	7.496.223	(7.499.434)	37.691	768.168	(23.382)	(35.113)	(277.351)	1.597.508
Nominelle Wechselkursbereinigung	14.859.343	(5.016.201)	–	–	–	–	–	–
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	170.932.376	148.655.790	801.008	766.794	39.412	63.116	4.911.186	5.217.976

* Die nominelle Wechselkursbereinigung ergibt sich sowohl aus der Rückumrechnung des Nettovermögens zu Beginn des Geschäftsjahres mit dem Wechselkurs zum 30. September 2021 als auch der Rückumrechnung der Posten in der Gewinn- und Verlustrechnung und der Geschäfte mit Anteilen mit dem durchschnittlichen Wechselkurs zum Kurs vom 30. September 2022. Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung) Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund 2022 Tsd. EUR	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund 2021 Tsd. EUR	BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund 2022 Tsd. EUR	BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund 2021 Tsd. EUR	BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund 2022 Tsd. GBP	BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund 2021 Tsd. GBP	BlackRock ICS Sterling Environmentally Aware Fund 2022 Tsd. GBP	BlackRock ICS Sterling Environmentally Aware Fund 2021 Tsd. GBP
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	35.441.389	44.727.056	6.407.229	4.842.655	2.415.663	3.723.745	4.959.189	2.333.907
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	(197.403)	(254.652)	(26.135)	(27.063)	16.754	(188)	12.509	64
Geschäfte mit Anteilen:								
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen	220.895.535	153.469.016	3.289.532	5.155.268	10.101.372	9.497.110	41.384.560	20.289.773
Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	(220.586.874)	(162.500.031)	(4.494.805)	(3.563.631)	(9.757.345)	(10.805.011)	(38.273.827)	(17.665.050)
Wiederangelegte Dividende	–	–	–	–	–	7	13.806	495
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen	308.661	(9.031.015)	(1.205.273)	1.591.637	344.027	(1.307.894)	3.124.539	2.625.218
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	35.552.647	35.441.389	5.175.821	6.407.229	2.776.444	2.415.663	8.096.237	4.959.189

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung) Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund
	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	36.632.983	41.811.246	2.157.619	2.674.794
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	22.043	261	5.804	3.197
			(723)	(302)
			73.702	6.322
Geschäfte mit Anteilen:				
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen	210.164.734	189.623.623	731.877	1.101.788
Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	(213.402.305)	(194.806.435)	(1.273.618)	(1.622.160)
Wiederangelegte Dividende	92.132	4.288	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen	(3.145.439)	(5.178.524)	(541.741)	(520.372)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	33.509.587	36.632.983	1.621.682	2.157.619
			4.065.874	3.975.172
			63.988.614	57.889.062

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung) Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund 2022 Tsd. USD	2021 Tsd. USD	BlackRock ICS US Treasury Fund 2022 Tsd. USD	2021 Tsd. USD
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	3.059.456	1.476.198	17.759.497	21.281.310
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	27.367	3.390	3.907	56
Geschäfte mit Anteilen:				
Ausgabe von rückkaufbaren Anteilen	4.231.528	3.429.740	165.072.917	145.380.456
Rücknahme von rückkaufbaren Anteilen	(2.971.117)	(1.849.872)	(161.355.288)	(148.904.563)
Wiederangelegte Dividende	–	–	40.638	2.238
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen	1.260.411	1.579.868	3.758.267	(3.521.869)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	4.347.234	3.059.456	21.521.671	17.759.497

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ

Zum 30. September 2022

		Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	Anm.	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
		Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		5.098.175	3.654.581	2.480	15.450	3.670	5.271	125.046	85.939
Zahlungsmitteläquivalente		243.894	315.738	–	1.293	–	–	–	–
Bareinschüsse		427	216	486	251	–	–	–	–
Barsicherheiten		110	107	–	–	50	50	–	–
Forderungen	11	367.505	469.807	1.077	1.958	–	–	5.232	394
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	169.263.429	148.925.267	798.983	764.353	35.699	57.835	4.796.970	5.198.622
Umlaufvermögen insgesamt		174.973.540	153.365.716	803.026	783.305	39.419	63.156	4.927.248	5.284.955
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Kontokorrentkredit		–	3.159	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Bareinschüsse		517	57	589	66	–	–	–	–
Verbindlichkeiten	12	4.026.243	4.698.982	38	16.161	7	40	16.062	66.979
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:	4	14.404	7.728	1.391	284	–	–	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		4.041.164	4.709.926	2.018	16.511	7	40	16.062	66.979
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	14	170.932.376	148.655.790	801.008	766.794	39.412	63.116	4.911.186	5.217.976

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Für die Verwaltungsratsmitglieder

Verwaltungsratsmitglied

26. Januar 2023

Verwaltungsratsmitglied

26. Januar 2023

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 30. September 2022

		BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	Anm.	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
		Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		979.670	851.071	189.144	117.193	80.623	81.340	165.027	30.803
Zahlungsmitteläquivalente		–	–	1.184	124.788	–	–	–	–
Barsicherheiten		50	50	25	25	–	–	–	–
Forderungen	11	27.087	1.866	11.968	1.614	403	–	23.429	617
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	34.832.535	35.640.960	5.633.976	6.487.173	3.101.185	2.484.672	8.174.233	5.059.987
Umlaufvermögen insgesamt		35.839.342	36.493.947	5.836.297	6.730.793	3.182.211	2.566.012	8.362.689	5.091.407
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Verbindlichkeiten	12	286.695	1.052.558	652.305	319.890	405.767	150.349	266.452	132.218
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	–	–	8.171	3.674	–	–	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		286.695	1.052.558	660.476	323.564	405.767	150.349	266.452	132.218
Den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen rückkaufbarer Anteile									
	14	35.552.647	35.441.389	5.175.821	6.407.229	2.776.444	2.415.663	8.096.237	4.959.189

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 30. September 2022

		BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
		2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
Anm.		Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
UMLAUFVERMÖGEN									
Zahlungsmittel		991.797	1.010.353	60.204	61.439	140.109	–	1.926.760	1.013.234
Zahlungsmitteläquivalente		–	–	70.000	95.000	–	–	–	–
Forderungen	11	175.591	15.213	10.019	30.381	4.619	45.155	92.179	507.261
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	33.472.882	37.100.372	1.541.599	2.016.240	4.045.079	3.980.351	63.212.638	57.286.092
Umlaufvermögen insgesamt		34.640.270	38.125.938	1.681.822	2.203.060	4.189.807	4.025.506	65.231.577	58.806.587
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
Kontokorrentkredit		–	–	–	–	–	4.260	–	–
Verbindlichkeiten	12	1.130.683	1.492.955	54.734	41.375	123.933	46.074	1.242.963	917.525
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	–	–	5.406	4.066	–	–	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		1.130.683	1.492.955	60.140	45.441	123.933	50.334	1.242.963	917.525
Den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen rückkaufbarer Anteile									
	14	33.509.587	36.632.983	1.621.682	2.157.619	4.065.874	3.975.172	63.988.614	57.889.062

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

BILANZ (Fortsetzung)
Zum 30. September 2022

		BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund 2022	2021	BlackRock ICS US Treasury Fund 2022	2021
	Anm.	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
UMLAUFVERMÖGEN					
Zahlungsmittel		42.721	16.299	859.380	1.055.979
Zahlungsmitteläquivalente		192.958	151.511	–	–
Forderungen	11	30.222	10.941	4.985	1.045
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	4.101.646	2.910.562	20.755.918	17.908.428
Umlaufvermögen insgesamt		4.367.547	3.089.313	21.620.283	18.965.452
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN					
Verbindlichkeiten	12	19.636	29.506	98.612	1.205.955
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4	677	351	–	–
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		20.313	29.857	98.612	1.205.955
Den Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnendes Nettovermögen rückkaufbarer Anteile					
	14	4.347.234	3.059.456	21.521.671	17.759.497

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS

1. Allgemeine Informationen

Das Unternehmen ist eine offene Investmentgesellschaft mit Sitz in Irland und nach irischem Recht als Public Limited Company organisiert. Das Unternehmen ist von der CBI zugelassen, unterliegt den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften und hat seinen eingetragenen Sitz in 200 Capital Dock, 79 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 RK57, Irland.

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.

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.

Alle Beträge wurden auf den nächsten Tausender 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 Schuldsinstrumenten, Liquiditätspapieren, umgekehrten Repogeschäften 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 First-In-First-Out-Kostenmethode („FIFO“) 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.

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 Zeitwerts erfolgt nach dem erstmaligen Ansatz wie folgt:

- Anlagen in Schuldsinstrumenten und börsenhandelten Derivaten, 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.
- Anlagen in außerbörslichen („OTC“) Derivaten werden mittels Bewertungstechniken bewertet.
- Anlagen in Liquiditätspapieren wie beispielsweise Termineinlagen und umgekehrten Repogeschäften werden zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet. Angesichts der kurzfristigen Natur solcher Anlagen wird diese Methode als äquivalent zum beizulegenden Zeitwert betrachtet.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.2 Finanzinstrumente (Fortsetzung)

2.2.4 Bestimmung des beizulegenden Zeitwertes (Fortsetzung)

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 die Verwahrstelle genehmigt wird) ermittelt. Dieser beizulegende Zeitwert muss auf Grundlage des wahrscheinlichen Realisierungswerts der Anlage ermittelt werden. 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.

2.2.5.3 Umgekehrte Repogeschäfte

Wenn der Fonds einen finanziellen Vermögenswert kauft und gleichzeitig eine Vereinbarung über den Rückverkauf desselben oder eines im Wesentlichen ähnlichen Vermögenswertes zu einem festen Preis zu einem künftigen Zeitpunkt abschließt (umgekehrte Repogeschäfte), wird die Vereinbarung in der Bilanz als Anlage in einem umgekehrten Repogeschäft erfasst und im Anhang zum Jahresabschluss als Sicherheit erhaltener Basiswert angegeben.

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.

Die rückkaufbaren Anteile 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.

Die rückkaufbaren Anteile werden an dem Tag erfasst, an dem das Handelsgeschäft 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.

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, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens 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.

Die Darstellungswährung der Abschlüsse des Unternehmens ist GBP.

NM0223U-2714371-36/244

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.3 Fremdwährungen (Fortsetzung)

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.

2.4.2 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 Anteilhabern durch das Unternehmen auf Zeitwertbasis zur Verfügung gestellt.

2.5 Zinserträge und Zinsaufwendungen

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

2.6 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.

2.7 Negative Rendite auf finanzielle Vermögenswerte

Negative Renditen für finanzielle Vermögenswerte im Zusammenhang mit Zinszahlungen auf Finanzinstrumente mit negativem Effektivzins werden täglich fortgeschrieben und über die Laufzeit des finanziellen Vermögenswerts in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

2.8 Ausschüttungen

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

Der Verwaltungsrat kann Ausschüttungen auf die Anteile der jeweiligen Klasse in Hinblick auf jeden Berichtszeitraum beschließen. Ausschüttungen können aus dem Nettoertrag des Fonds erfolgen.

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 Anteilhaber zurückgegeben, die während des Geschäftsjahres Anteile vom Fonds gezeichnet oder an diese zurückgegeben haben. Der Ausgleichsanteil der Ausschüttung wird als eine Kapitalrückzahlung behandelt.

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

2.9 Änderungen am Bilanzierungsstandard

2.9.1 Im Geschäftsjahr übernommene Änderungen am FRS 102

Reform der Referenzzinssätze (Phase 2)

Die Änderung am FRS 102 soll die Rechnungslegungsvorschriften im Zusammenhang mit der Reform der Referenzzinssätze übernehmen und vereinfachen und neue Vorschriften zur Angabe von Art und Umfang von Risiken einführen, die sich aus der Reform der Referenzzinssätze ergeben. Diese Änderungen wirkten sich nicht auf den Abschluss des Unternehmens aus, da es zum Bilanzstichtag keine wesentliche Finanzinstrumente hält, die der IBOR-Reform unterliegen.

3. Finanzielle Risiken

Die Anlageaktivitäten jedes Fonds setzen diesen verschiedenen Arten 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 das Basisinformationsblatt zurate ziehen.

3.1 Risikomanagementrahmen

Der Verwaltungsrat prüft die Quartalsberichte zum Anlageergebnis vierteljährlich und erhält halbjährlich eine Präsentation des Investmentmanagers zur Wertentwicklung des Unternehmens sowie zum Risikoprofil während des Geschäftsjahres. Der Verwaltungsrat hat die laufende Verwaltung des Anlageprogramms an den Investmentmanager delegiert. Der Investmentmanager ist ferner dafür verantwortlich sicherzustellen, dass das Unternehmen gemäß den im Prospekt aufgeführten Anlagerichtlinien und -beschränkungen verwaltet wird. Der Verwaltungsrat behält sich die Kontrolle des Anlageergebnisses und des Produktrisikos sowie die Verantwortung für die Überwachung und Kontrolle des regulatorischen und betrieblichen Risikos für das Unternehmen vor. 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. RQA Group verfolgt die tatsächlich in jedem einzelnen Fonds eingesetzten Risikomanagementverfahren. Durch Aufgliederung der Komponenten des Prozesses kann die RQA Group feststellen, ob fondsübergreifend 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 Aktien 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.

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	2022 %	2021 %
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	0,04	0,01
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	0,00	0,00
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	0,01	0,00
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	0,02	0,00
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	0,02	0,00
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	0,01	0,00
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	0,03	0,00
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	0,03	0,00
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	0,07	0,01
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	0,02	0,00
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	0,02	0,00
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	0,03	0,00
BlackRock ICS US Treasury Fund	0,01	0,00

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.2 Marktrisiko (Fortsetzung)

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.

Bestehendes Fremdwährungsrisiko

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 Geschäftsjahres bestehenden, der Absicherung des Fremdwährungsrisikos dienenden offenen Devisenterminkontrakte sind in den Aufstellungen der Vermögenswerte angegeben.

Alle oder im Wesentlichen alle Anlagen der einzelnen Fonds lauten auf die funktionale Währung des jeweiligen Fonds und waren daher zum 30. September 2022 und zum 30. September 2021 keinem direkten Fremdwährungsrisiko ausgesetzt.

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.

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, Rezessionen 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.

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.

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

Einige Fonds können 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.3 Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Steuerung der Liquiditätsrisiken

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 Anteilhabern eines Fonds an einem bestimmten Handelstag 10 % des NIW des 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 bestimmten Handelstag nicht zurückgenommen werden, werden an jedem folgenden Handelstag anteilig zurückgenommen und nicht vorrangig vor später eingehenden Anträgen behandelt.

Keiner der Vermögenswerte der Fonds unterliegt speziellen Liquiditätsvereinbarungen.

Die Bewertungen (und folglich Ausgaben, Rücknahmen und Übertragungen) von Anteilen eines Fonds oder einer Klasse können unter bestimmten Umständen vorübergehend ausgesetzt werden, u. a.:

(i) die Schließung oder Aussetzung oder Einschränkung des Handels an einer Börse oder einem Markt, an dem ein wesentlicher Teil der betreffenden Anlagen notiert ist oder gehandelt wird;

(ii) unter Bedingungen, denen zufolge es nach Ansicht des Verwaltungsrats unpraktisch oder unangemessen ist, die im Fonds gehaltenen Anlagen zu veräußern, ohne der Gesellschaft oder den Anteilhabern einer Klasse ernsthaft zu schaden;

(iii) wenn die Kommunikationsmittel, die normalerweise zur Bestimmung des Preises oder des Werts der vom Fonds gehaltenen Anlagen verwendet werden, nicht genutzt werden können oder aus einem anderen Grund der Preis oder Wert dieser Anlagen nicht normal, schnell und korrekt bestimmt werden kann;

(iv) wenn ein für den Handel mit den betreffenden Anlagen erforderlicher Geldtransfer nicht wie gewöhnlich zu normalen Wechselkursen durchgeführt werden kann;

(v) bei Ankündigung einer Versammlung, auf der ein Beschluss zur Auflösung der Gesellschaft vorgeschlagen werden soll, oder wenn die Schließung eines Fonds wie im Abschnitt „Schließung und Auflösung“ erläutert, angekündigt oder beschlossen wurde;

(vi) im Falle der LVNAV Liquidity Funds und der Sovereign Funds, falls der Anteil der wöchentlich fällig werdenden Vermögenswerte unter 30 % des Gesamtvermögens fällt, die täglichen Nettorücknahmen an einem Handelstag 10 % des Gesamtvermögens übersteigen und der Verwaltungsrat der Ansicht ist, dass es im besten Interesse der Anteilhaber liegt, oder

(vii) im Falle der LVNAV Liquidity Funds und Sovereign Funds, falls der Anteil der wöchentlich fällig werdenden Vermögenswerte unter 10 % des Gesamtvermögens fällt und der Verwaltungsrat der Meinung ist, dass dies im besten Interesse der Anteilhaber liegt.

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 oder einer ähnlichen Vereinbarung 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.

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 & Concentration 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 30. September 2022 und 30. September 2021 bestanden keine überfälligen oder wertgeminderten Salden im Zusammenhang mit Transaktionen mit Kontrahenten.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

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.

Devisenterminkontrakte bedürfen keiner Variation-Marge. Deshalb wird das Kredit-/Kontrahentenrisiko durch das Team von BlackRock RQA Counterparty & Concentration Risk überwacht, das die Bonität des Kontrahenten kontrolliert.

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-FDI-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 30. September 2022		Niedrigstes Bonitätsrating eines einzelnen Kontrahenten	Höchstrisiko gegenüber einem einzelnen Kontrahenten Tsd.	Im Zusammenhang mit dem maximalen Risiko erhaltene Gesamtsicherheiten Tsd.
Währung	Gesamtzahl der Kontrahenten			
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	EUR	2	A	–
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	EUR	5	A	3.089
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	GBP	7	A-	229
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	USD	8	A-	7.324

Zum 30. September 2021		Niedrigstes Bonitätsrating eines einzelnen Kontrahenten	Höchstrisiko gegenüber einem einzelnen Kontrahenten Tsd.	Im Zusammenhang mit dem maximalen Risiko erhaltene Gesamtsicherheiten Tsd.
Währung	Gesamtzahl der Kontrahenten			
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	EUR	2	A	–
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	EUR	6	BBB+	–
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	GBP	7	BBB+	–
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	USD	5	A	471

3.4.2 Verwahrstelle

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

3.4.2 Verwahrstelle (Fortsetzung)

Im Wesentlichen alle Zahlungsmittel der einzelnen Fonds werden von dem verbundenen Unternehmen der Verwahrstelle, der JP Morgan Chase Bank NA, in ihrer Eigenschaft als Bank („das verbundene Unternehmen der Verwahrstelle“) gehalten.

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

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

Das langfristige Rating der Muttergesellschaft der Verwahrstelle zum 30. September 2022 beträgt A+ (30. September 2021: A+) (Standard & Poor's Rating).

Um das Kontrahentenausfallrisiko jedes Fonds gegenüber dem verbundenen Unternehmen der Verwahrstelle oder Depotbanken weiter zu verringern, kann jeder Fonds zusätzliche Vereinbarungen treffen, beispielsweise über die Platzierung von Restbeträgen in einem Geldmarktfonds.

3.4.3 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. Eine Reihe von Anlagen der Fonds in Staats- und Unternehmensanleihen setzen diese dem Ausfallrisiko des Emittenten in Hinblick auf Zins- oder Kapitalzahlungen aus.

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

Zum 30. September 2022		Schuld- instrumente, Anteil Investment- Grade in %	Schuld- instrumente, Anteil Non- Investment- Grade in %	Schuld- instrumente, Anteil Titel ohne Rating in %	Schuld- instrumente, Gesamtanteil in %
	Währung				
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	GBP	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	GBP	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	GBP	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	USD	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	USD	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	USD	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS US Treasury Fund	USD	100,00	–	–	100,00

Zum 30. September 2021		Schuld- instrumente, Anteil Investment- Grade in %	Schuld- instrumente, Anteil Non- Investment- Grade in %	Schuld- instrumente, Anteil Titel ohne Rating in %	Schuld- instrumente, Gesamtanteil in %
	Währung				
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	EUR	95,72	–	4,28	100,00
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	EUR	96,85	–	3,15	100,00
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	EUR	97,04	–	2,96	100,00
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	GBP	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	GBP	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	GBP	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	USD	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	USD	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	USD	100,00	–	–	100,00
BlackRock ICS US Treasury Fund	USD	100,00	–	–	100,00

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

3. Finanzielle Risiken (Fortsetzung)

3.4 Kontrahentenausfallrisiko (Fortsetzung)

3.4.3 Emittentenausfallrisiko in Bezug auf Schuldinstrumente (Fortsetzung)

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.

3.4.4 Emittentenausfallrisiko in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte

Emittenten- und/oder Kontrahentenausfallrisiken entstehen den einzelnen Fonds auch durch deren Anlagen in umgekehrten Repogeschäften.

Alle umgekehrten Repogeschäfte werden von jedem Fonds mit einer Gegenpartei im Rahmen eines Global Master Repurchase Agreements („GMRA“) abgeschlossen. Alle Sicherheiten, die ein jeder Fonds im Rahmen von GMRA erhält, werden bilateral gemäß einem Titelabtretungsvertrag übertragen. Die von den einzelnen Fonds erhaltenen Sicherheiten werden auf einem Konto im Namen der Verwahrstelle für die einzelnen Fonds und im Falle von Dreiparteien-Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften mit einem Dreiparteien-Sicherheitenverwalter im Namen der Verwahrstelle für die einzelnen Fonds gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden von den Vermögenswerten der Verwahrstelle des jeweiligen Fonds getrennt.

Die folgenden Tabellen enthalten Angaben zum Wert der Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften und der zugehörigen erhaltenen Sicherheiten.

Name des Fonds	Währung	Wert der umgekehrten Repogeschäften	Wert der erhaltenen Sicherheiten	Wert der umgekehrten Repogeschäften	Wert der erhaltenen Sicherheiten
		30. September 2022 Tsd.	30. September 2021 Tsd.	30. September 2021 Tsd.	Tsd.
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR	16.000	16.447	8.000	8.200
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	EUR	100.000	102.062	250.000	257.345
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	EUR	3.544.500	3.606.019	3.742.000	3.827.176
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP	2.665.178	2.714.171	1.367.211	1.370.075
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	GBP	1.059.324	1.088.038	551.010	552.341
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	GBP	6.081.504	6.195.892	5.278.431	5.280.436
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	USD	923.000	938.782	472.000	480.233
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	USD	12.230.000	12.414.819	4.703.000	4.802.997
BlackRock ICS US Treasury Fund	USD	12.060.001	12.153.051	11.732.000	11.910.865

Am 30. September 2022 und 30. September 2021 setzen sich die Sicherheiten überwiegend aus Schuldinstrumenten zusammen.

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

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“) handelt, werden 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, berechnet. Der ungeprüfte NIW des zugrunde liegenden Beteiligungsanteils an einem CIS wird vor Abzug von Rücknahmekosten ausgewiesen, die gegebenenfalls bei einer Rückgabe an diesen zugrunde liegenden CIS anfallen können. Der ungeprüfte NIW des zugrunde liegenden Investmentfonds („CIS“) 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-Anpassungsfaktoren, um die Differenz zwischen dem letzten Marktschluss und dem Bewertungszeitpunkt jedes Fonds widerzuspiegeln;
- (iv) bei notleidenden Schuldtiteln die Verwendung jüngster Transaktionen und notleidender Aktieninstrumente, für die keine Marktdaten verfügbar sind;
- (v) bei 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) bei Devisentermingeschäften der Barwert zukünftiger Cashflows auf der Grundlage der Devisenterminkurse am Bilanzstichtag;
- (viii) bei 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;
- (ix) für Fremdwahrungsoptionen, Optionspreismodelle; und
- (x) bei anderen Finanzinstrumenten: Discounted-Cashflow-Analysen.

Alle sich daraus ergebenden Schätzungen des beizulegenden Zeitwerts sind in Ebene 2 enthalten, mit Ausnahme von nicht notierten Aktienpapieren, einer zu zahlenden Gegenleistung und bestimmten Derivatkontrakten, bei denen die beizulegenden Zeitwerte auf der Grundlage von Barwerten bestimmt wurden und die verwendeten Diskontsätze für das Kontrahentenrisiko oder das eigene Kreditrisiko angepasst wurden, oder bestimmten CIS, für die Barrieren oder Rücknahmebeschränkungen gelten und die nicht innerhalb von 90 Tagen zurückgenommen werden können. Diese sind in Ebene 3 enthalten.

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.

Die folgenden Tabellen zeigen eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds zum 30. September 2022 und 30. September 2021:

30. September 2022	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	442.350	–	442.350
Einlagenzertifikate	–	83.612	–	83.612
Anleihen	–	272.086	–	272.086
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	472	–	472
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten (Futures)	463	–	–	463
Gesamt	463	798.520	–	798.983
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(1.391)	–	(1.391)
Gesamt	–	(1.391)	–	(1.391)
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	19.699	–	19.699
Umgekehrte Repogeschäfte	–	16.000	–	16.000
Gesamt	–	35.699	–	35.699
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	1.639.984	–	1.639.984
Einlagenzertifikate	–	1.066.296	–	1.066.296
Termineinlagen	–	1.839.854	–	1.839.854
Anleihen	–	150.836	–	150.836
Umgekehrte Repogeschäfte	–	100.000	–	100.000
Gesamt	–	4.796.970	–	4.796.970

NM0223U-2714371-44/244

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

30. September 2022	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	14.914.834	–	14.914.834
Einlagenzertifikate	–	10.027.403	–	10.027.403
Termineinlagen	–	4.356.186	–	4.356.186
Anleihen	–	1.989.612	–	1.989.612
Umgekehrte Repogeschäfte	–	3.544.500	–	3.544.500
Gesamt	–	34.832.535	–	34.832.535
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	3.675.215	–	3.675.215
Einlagenzertifikate	–	675.464	–	675.464
Termineinlagen	–	242.954	–	242.954
Anleihen	–	1.037.201	–	1.037.201
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	3.142	–	3.142
Gesamt	–	5.633.976	–	5.633.976
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(8.171)	–	(8.171)
Gesamt	–	(8.171)	–	(8.171)
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	436.007	–	436.007
Umgekehrte Repogeschäfte	–	2.665.178	–	2.665.178
Gesamt	–	3.101.185	–	3.101.185
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	2.372.131	–	2.372.131
Commercial Papers	–	1.386.999	–	1.386.999
Termineinlagen	–	2.501.801	–	2.501.801
Anleihen	–	853.979	–	853.979
Umgekehrte Repogeschäfte	–	1.059.323	–	1.059.323
Gesamt	–	8.174.233	–	8.174.233
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	12.396.283	–	12.396.283
Commercial Papers	–	5.148.913	–	5.148.913
Termineinlagen	–	4.767.163	–	4.767.163
Anleihen	–	5.079.019	–	5.079.019
Umgekehrte Repogeschäfte	–	6.081.504	–	6.081.504
Gesamt	–	33.472.882	–	33.472.882
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	684.122	–	684.122
Commercial Papers	–	461.516	–	461.516
Termineinlagen	–	269.759	–	269.759
Anleihen	–	125.923	–	125.923
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	279	–	279
Gesamt	–	1.541.599	–	1.541.599
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(5.406)	–	(5.406)
Gesamt	–	(5.406)	–	(5.406)
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	1.492.172	–	1.492.172
Einlagenzertifikate	–	1.101.537	–	1.101.537
Termineinlagen	–	504.709	–	504.709
Anleihen	–	23.661	–	23.661
Umgekehrte Repogeschäfte	–	923.000	–	923.000
Gesamt	–	4.045.079	–	4.045.079
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	21.108.220	–	21.108.220
Einlagenzertifikate	–	19.678.292	–	19.678.292
Termineinlagen	–	9.904.360	–	9.904.360
Anleihen	–	291.766	–	291.766
Umgekehrte Repogeschäfte	–	12.230.000	–	12.230.000
Gesamt	–	63.212.638	–	63.212.638

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

30. September 2022	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	2.728.313	–	2.728.313
Bankakzepte	–	113.078	–	113.078
Einlagenzertifikate	–	971.250	–	971.250
Anleihen	–	267.349	–	267.349
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	21.656	–	21.656
Gesamt	–	4.101.646	–	4.101.646
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(677)	–	(677)
Gesamt	–	(677)	–	(677)
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	8.695.917	–	8.695.917
Umgekehrte Repogeschäfte	–	12.060.001	–	12.060.001
Gesamt	–	20.755.918	–	20.755.918
30. September 2021	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	220.828	–	220.828
Einlagenzertifikate	–	90.197	–	90.197
Anleihen	–	453.262	–	453.262
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten (Futures)	66	–	–	66
Gesamt	66	764.287	–	764.353
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(284)	–	(284)
Gesamt	–	(284)	–	(284)
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	49.835	–	49.835
Umgekehrte Repogeschäfte	–	8.000	–	8.000
Gesamt	–	57.835	–	57.835
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	2.023.169	–	2.023.169
Einlagenzertifikate	–	1.141.553	–	1.141.553
Termineinlagen	–	1.562.192	–	1.562.192
Anleihen	–	221.708	–	221.708
Umgekehrte Repogeschäfte	–	250.000	–	250.000
Gesamt	–	5.198.622	–	5.198.622
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	14.863.779	–	14.863.779
Einlagenzertifikate	–	9.954.031	–	9.954.031
Termineinlagen	–	4.153.575	–	4.153.575
Anleihen	–	2.927.575	–	2.927.575
Umgekehrte Repogeschäfte	–	3.742.000	–	3.742.000
Gesamt	–	35.640.960	–	35.640.960
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	2.794.139	–	2.794.139
Einlagenzertifikate	–	1.585.239	–	1.585.239
Termineinlagen	–	409.443	–	409.443
Anleihen	–	1.697.883	–	1.697.883
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	469	–	469
Gesamt	–	6.487.173	–	6.487.173
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(3.674)	–	(3.674)
Gesamt	–	(3.674)	–	(3.674)
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	1.117.461	–	1.117.461
Umgekehrte Repogeschäfte	–	1.367.211	–	1.367.211
Gesamt	–	2.484.672	–	2.484.672

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

4. Angaben zur Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

30. September 2021	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Gesamt
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	1.937.707	–	1.937.707
Commercial Papers	–	1.395.598	–	1.395.598
Termineinlagen	–	1.118.384	–	1.118.384
Anleihen	–	57.288	–	57.288
Umgekehrte Repogeschäfte	–	551.010	–	551.010
Gesamt	–	5.059.987	–	5.059.987
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	16.444.755	–	16.444.755
Commercial Papers	–	10.547.270	–	10.547.270
Termineinlagen	–	3.659.911	–	3.659.911
Anleihen	–	1.170.005	–	1.170.005
Umgekehrte Repogeschäfte	–	5.278.431	–	5.278.431
Gesamt	–	37.100.372	–	37.100.372
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	550.039	–	550.039
Commercial Papers	–	676.724	–	676.724
Termineinlagen	–	219.009	–	219.009
Anleihen	–	570.447	–	570.447
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	21	–	21
Gesamt	–	2.016.240	–	2.016.240
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(4.066)	–	(4.066)
Gesamt	–	(4.066)	–	(4.066)
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	1.981.069	–	1.981.069
Einlagenzertifikate	–	1.029.715	–	1.029.715
Termineinlagen	–	405.800	–	405.800
Anleihen	–	91.767	–	91.767
Umgekehrte Repogeschäfte	–	472.000	–	472.000
Gesamt	–	3.980.351	–	3.980.351
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Commercial Papers	–	24.556.307	–	24.556.307
Einlagenzertifikate	–	17.238.326	–	17.238.326
Termineinlagen	–	9.941.230	–	9.941.230
Anleihen	–	847.229	–	847.229
Umgekehrte Repogeschäfte	–	4.703.000	–	4.703.000
Gesamt	–	57.286.092	–	57.286.092
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Einlagenzertifikate	–	1.003.394	–	1.003.394
Commercial Papers	–	1.580.417	–	1.580.417
Bankakzepte	–	13.965	–	13.965
Anleihen	–	311.379	–	311.379
Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten	–	1.407	–	1.407
Gesamt	–	2.910.562	–	2.910.562
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten	–	(351)	–	(351)
Gesamt	–	(351)	–	(351)
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden				
Zeitwert bewertet:				
Anleihen	–	6.176.428	–	6.176.428
Umgekehrte Repogeschäfte	–	11.732.000	–	11.732.000
Gesamt	–	17.908.428	–	17.908.428

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

5. Betriebliche Erträge

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	29.129	2.068	–	–	–	–	–	–
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	789.879	165.876	1.036	–	2	–	2.118	–
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	188.846	6.768	–	–	2	–	14	–
Gesamt	1.007.854	174.712	1.036	–	4	–	2.132	–

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	–	–	–	–	598	39	1.165	14
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	14.213	–	5.483	–	2.260	1.647	47.867	3.776
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	623	–	–	–	16.116	512	8.771	186
Gesamt	14.836	–	5.483	–	18.974	2.198	57.803	3.976

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

5. Betriebliche Erträge (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	7.798	504	818	69	1.016	38	14.798	1.069
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	224.894	54.054	12.065	7.859	31.473	5.221	502.801	98.950
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	39.617	2.050	–	–	5.072	312	39.401	2.714
Gesamt	272.309	56.608	12.883	7.928	37.561	5.571	557.000	102.733

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2022	2021	2022	2021
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinserträge aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	1.743	173	6.451	694
Zinserträge aus finanziellen Vermögenswerten	36.552	9.118	48.167	21.586
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	–	–	114.040	2.476
Gesamt	38.295	9.291	168.658	24.756

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Verzicht auf Managementgebühren	20.900	44.242	–	–	31	34	860	513
Managementgebühren	(167.561)	(158.305)	(431)	(142)	(50)	(110)	(3.711)	(2.516)
Gesamt	(146.661)	(114.063)	(431)	(142)	(19)	(76)	(2.851)	(2.003)

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Verzicht auf Managementgebühren	11.535	12.107	–	–	461	2.425	73	625
Managementgebühren	(39.165)	(39.211)	(4.132)	(3.557)	(2.518)	(3.320)	(3.942)	(2.170)
Gesamt	(27.630)	(27.104)	(4.132)	(3.557)	(2.057)	(895)	(3.869)	(1.545)

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Verzicht auf Managementgebühren	2.074	16.005	–	–	39	40	3.075	4.666
Managementgebühren	(36.232)	(39.168)	(1.285)	(1.450)	(1.658)	(1.274)	(72.390)	(68.965)
Gesamt	(34.158)	(23.163)	(1.285)	(1.450)	(1.619)	(1.234)	(69.315)	(64.299)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

6. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2022 Tsd. USD	2021 Tsd. USD	2022 Tsd. USD	2021 Tsd. USD
Verzicht auf Managementgebühren	–	–	6.830	14.647
Managementgebühren	(2.701)	(2.255)	(29.984)	(26.656)
Gesamt	(2.701)	(2.255)	(23.154)	(12.009)

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

Die Verwaltungsgesellschaft hat mit dem Unternehmen vereinbart, die jährlichen Aufwendungen (wie im Verkaufsprospekt definiert) jeder Klasse eines Fonds auf maximal 1 % pro Jahr des NIW dieser Klasse oder auf einen geringeren Betrag – den die Verwaltungsgesellschaft für jede Klasse eines Fonds vereinbaren kann – zu begrenzen. Die Verwaltungsgesellschaft 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. Die Gebühr läuft auf täglicher Basis auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar.

Da jede freiwillige Obergrenze von der Verwaltungsgesellschaft auf freiwilliger Basis vereinbart wurde, kann die Verwaltungsgesellschaft von Zeit zu Zeit die freiwillige Obergrenze in Bezug auf eine bestimmte Klasse in einem Fonds durch Mitteilung an die Gesellschaft erhöhen oder verringern. In einem solchen Fall wird die Gesellschaft die Anteilhaber der betreffenden Klasse benachrichtigen (die Verwaltungsgesellschaft wird die Obergrenze jedoch nicht ohne die Zustimmung der Anteilhaber der betreffenden Klasse über 1 % erhöhen). Des Weiteren kann eine freiwillige Obergrenze nicht über den entsprechenden Höchstbetrag hinaus erhöht werden, ohne die Anteilhaber der betreffenden Klasse darüber 30 Tage im Voraus schriftlich zu informieren.

Der Verzicht auf Managementgebühren ist in der Anmerkung 6 zu den betrieblichen Aufwendungen dargelegt.

Ferner wurde mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart, dass die jährlichen Aufwendungen eines Fonds den in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Obergrenzen unterliegen:

Anteilklasse	Managementgebühren (inkl. der Gebühren von Fondsverwalter, Verwahrstelle und Investmentmanager): %
Anteilklasse Accumulating	0,055
Admin I Shares	0,25
Anteilklasse Admin II	0,30
Anteilklasse Admin III	0,45
Anteilklasse Admin IV	0,70
Anteilklasse Agency	0,03
Anteilklasse Aon Captives	0,15
Anteilklasse Core	0,20
Klasse FA	0,20
Anteilklasse G Accumulating II	0,25
Anteilklasse G Accumulating	0,20
Anteilklasse G Distributing I	0,15
Anteilklasse G Distributing II	0,25
Anteilklasse G Distributing	0,20
Anteilklasse Heritage	0,125
Anteilklasse J (Acc)	0,06
Anteilklasse J (Dis)	0,06
Klasse N	0,20
Anteilklasse Premier	0,10
Anteilklasse S (Acc)	0,10
Anteilklasse Select	0,15

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

7. Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzinstrumenten

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	(808)	(2.405)	(49)	(60)	–	–	16	(16)
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	(35.392)	(19.590)	(3.551)	349	–	–	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	(28.406)	(823)	(2.878)	46	–	–	(2.269)	16
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	12.732	(7.120)	(237)	(218)	–	–	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	22.066	24.909	5.098	(208)	–	–	–	–
Gesamt	(29.808)	(5.029)	(1.617)	(91)	–	–	(2.253)	–

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	413	85	(1.043)	(1.269)	–	–	1	1
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	(30.316)	(16.859)	–	–	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	–	–	(3.853)	1.049	–	–	(7.813)	(76)
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	(1.824)	(3.205)	–	–	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	–	–	28.889	18.076	–	–	–	–
Gesamt	413	85	(8.147)	(2.208)	–	–	(7.812)	(75)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	5	(819)	(4)	–	4	28	(336)	196
Net realised gains/(losses) on financial derivative and other instruments	–	–	(13.520)	1.563	–	–	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	–	–	(5.627)	(984)	(2.288)	(403)	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	–	–	(1.082)	(4.673)	–	–	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	–	–	16.096	3.127	–	–	–	–
Gesamt	5	(819)	(4.137)	(967)	(2.284)	(375)	(336)	196

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2022	2021	2022	2021
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	7	11	7	(900)
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	8.728	(9.222)	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/(Verluste) aus Anlagen in Wertpapieren	(7.113)	(600)	–	–
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne/ (Verluste) aus derivativen und sonstigen Finanzinstrumenten	19.923	742	–	–
Nettowährungsgewinne/(-verluste) aus anderen Instrumenten	(29.220)	8.463	–	–
Gesamt	(7.675)	(606)	7	(900)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

8. Zinsaufwendungen oder ähnliche Aufwendungen

Die Zinsaufwendungen oder ähnlichen Aufwendungen in der Gewinn- und Verlustrechnung setzen sich ausschließlich aus Zinsaufwendungen für Zahlungsmittel für die Fonds zusammen.

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 sechs 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:

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Anteilklasse Admin I (Dis)	(23)	(1)	–	–	–	–	(23)	(1)
Anteilklasse Admin II (Dis)	(258)	(4)	–	–	–	–	(1)	–
Anteilklasse Admin III (Dis)	(358)	(5)	–	–	–	–	(74)	(1)
Anteilklasse Agency (Acc T0)	–	(5)	–	(5)	–	–	–	–
Anteilklasse Agency (Dis)	(137.291)	(12.548)	–	–	(29.306)	(758)	(46.638)	(4.673)
Anteilklasse Aon Captives	(1.373)	(65)	–	–	–	–	(628)	(1)
Anteilklasse Core (Dis)	(101.921)	(2.140)	–	–	(40)	(2)	(8.779)	(109)
Anteilklasse G Distributing I	(59)	(18)	–	–	–	–	(13)	–
Anteilklasse G Distributing	(619)	(37)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse G Heritage (Dis)	(14)	–	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Heritage (Dis)	(139.133)	(5.487)	–	–	(977)	(1)	(54.545)	(547)
Anteilklasse J (Dis)	(530)	(416)	–	–	–	–	–	–
Klasse N	(355)	(12)	–	–	–	–	–	–
Anteilklasse Premier (Dis)	(306.406)	(15.977)	–	–	(3.167)	(11)	(95.659)	(877)
Anteilklasse Select (Dis)	(22.646)	(418)	–	–	–	–	(8.911)	(86)
Gesamt	(710.986)	(37.133)	–	(5)	(33.490)	(772)	(215.271)	(6.295)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

9. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile (Fortsetzung)

	BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund		BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Anteilklasse Admin II (Dis)	–	–	–	–	(329)	(5)	–	–
Anteilklasse Admin III (Dis)	–	–	–	–	(318)	(5)	–	–
Anteilklasse Agency (Dis)	(890)	(709)	(32.648)	(3.859)	(40.774)	(4.676)	–	–
Anteilklasse Aon Captives	–	–	–	–	(954)	(87)	–	–
Anteilklasse Core (Dis)	–	–	(790)	(12)	(64.498)	(2.158)	–	–
Anteilklasse G Distributing I	–	–	–	–	(59)	(24)	–	–
Anteilklasse G Distributing	–	–	–	–	(791)	(51)	–	–
Anteilklasse G Heritage (Dis)	–	–	–	–	(15)	–	–	–
Anteilklasse Heritage (Dis)	–	–	(239)	(37)	(94.859)	(6.352)	(197)	–
Anteilklasse J (Dis)	(259)	(244)	–	–	–	–	(347)	(236)
Klasse N	–	–	–	–	(455)	(16)	–	–
Anteilklasse Premier (Dis)	(148)	(81)	(665)	(91)	(197.187)	(18.536)	–	(116)
Anteilklasse Select (Dis)	–	–	(39)	(11)	(13.408)	(398)	–	–
Gesamt	(1.297)	(1.034)	(34.381)	(4.010)	(413.647)	(32.308)	(544)	(352)

	BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2022	2021
	Tsd. USD	Tsd. USD
Anteilklasse Admin III (Dis)	(46)	(1)
Anteilklasse Agency (Dis)	(3.988)	(236)
Anteilklasse Core (Dis)	(53.920)	(607)
Anteilklasse G Distributing	(2)	–
Anteilklasse G Heritage (Dis)	(2)	–
Anteilklasse Heritage (Dis)	(11.761)	(371)
Anteilklasse Premier (Dis)	(67.745)	(1.800)
Anteilklasse Select (Dis)	(4.140)	(46)
Gesamt	(141.604)	(3.061)

10. Irische Besteuerung

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. Ein steuerlich relevantes Ereignis umfasst Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber oder die Einlösung, Rücknahme, Annullierung oder Übertragung von Anteilen sowie das Halten von Anteilen am Ende eines jeden Achtjahreszeitraums, beginnend mit dem Erwerb der Anteile.

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

- 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
- bestimmten, von der Steuerpflicht befreiten, in Irland ansässigen Anteilinhabern, die dem Unternehmen die nötigen 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen

Zum 30. September 2022

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	1.130	22	–	–	–	–	7	–
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	140.665	16.756	958	1.958	–	–	212	199
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	7.043	20	–	–	–	–	–	–
Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren	4.389	251.763	–	–	–	–	4.999	–
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	214.260	44.421	119	–	–	–	14	195
Sonstige Forderungen	18	156.825	–	–	–	–	–	–
Gesamt	367.505	469.807	1.077	1.958	–	–	5.232	394

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	58	–	51	–	14	–	30	–
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	1.343	153	1.285	1.614	–	–	10.307	615
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	–	–	–	–	389	–	147	–
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	25.686	1.713	10.632	–	–	–	12.945	2
Gesamt	27.087	1.866	11.968	1.614	403	–	23.429	617

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

11. Forderungen (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	190	1	99	6	36	–	489	3
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	52.604	8.196	2.371	1.106	4.302	134	68.664	2.590
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	863	1	–	–	234	1	3.081	9
Noch nicht abgerechnete Verkäufe von Wertpapieren	–	–	–	29.269	–	45.000	–	255.000
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	121.934	7.015	7.549	–	26	20	19.945	48.204
Sonstige Forderungen	–	–	–	–	21	–	–	201.455 ¹
Gesamt	175.591	15.213	10.019	30.381	4.619	45.155	92.179	507.261

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2022	2021	2022	2021
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zinsforderungen aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	34	15	216	2
Zinsforderungen aus finanziellen Vermögenswerten	5.822	926	1.643	1.027
Zinserträge aus umgekehrten Repogeschäften	–	–	2.985	16
Noch nicht abgerechnete Anteilszeichnungen	24.366	–	141	–
Sonstige Forderungen	–	10.000 ¹	–	–
Gesamt	30.222	10.941	4.985	1.045

¹Sonstige Forderungen enthalten Beträge im Zusammenhang mit gekauften, jedoch noch nicht ausgegebenen Wertpapieren.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten

Zum 30. September 2022

	Institutional Cash Series Plc		BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund		BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022 Tsd. GBP	2021 Tsd. GBP	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	218.561	2.517	–	–	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	220	62	–	–	–	–	1	1
Zinsaufwendungen für Liquiditätspapiere	106	89	–	–	–	–	3	26
Verzicht auf Managementgebühren	(442)	(27.290)	–	–	(1)	(23)	(61)	(365)
Zahlbare Managementgebühren	16.525	93.104	38	142	4	59	307	1.698
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	3.438.772	4.541.267	–	16.019	–	–	14.998	65.154
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	350.441	83.116	–	–	–	–	811	176
Zinsverbindlichkeiten aus umgekehrten Repogeschäften	78	84	–	–	–	–	3	6
Sonstige Zinsverbindlichkeiten	–	2.174	–	–	–	–	–	283
Sonstige Verbindlichkeiten	1.982	3.859	–	–	4	4	–	–
Gesamt	4.026.243	4.698.982	38	16.161	7	40	16.062	66.979

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	–	–	–	–	–	–	7.759	115
Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	–	13	–	53	–	–	50	–
Zinsaufwendungen für Liquiditätspapiere	117	71	–	8	–	–	–	–
Verzicht auf Managementgebühren	(551)	(6.803)	–	–	3	(1.170)	–	(396)
Zahlbare Managementgebühren	3.603	21.936	330	2.399	263	1.676	437	1.509
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	276.964	1.012.618	433.823	317.157	405.470	149.810	203.802	130.971
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	5.303	21.342	218.152	–	–	–	54.404	19
Zinsverbindlichkeiten aus umgekehrten Repogeschäften	86	84	–	–	–	1	–	–
Sonstige Zinsverbindlichkeiten	–	1.973	–	273	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten	1.173	1.324	–	–	31	32	–	–
Gesamt	286.695	1.052.558	652.305	319.890	405.767	150.349	266.452	132.218

	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fonds		BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fonds	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	47.973	518	748	419	8.906	288	128.330	1.422
Zinsverbindlichkeiten für Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	126	1	–	–	17	1	32	4
Verzicht auf Managementgebühren	–	(8.277)	–	–	–	(38)	–	(4.178)
Zahlbare Managementgebühren	3.011	22.931	100	857	139	823	6.815	40.364
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	1.052.789	1.441.919	50.997	40.099	114.871	45.000	1.095.542	856.327
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	26.776	35.857	2.889	–	–	–	11.325	20.874
Zinsverbindlichkeiten aus umgekehrten Repogeschäften	–	4	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten	8	2	–	–	–	–	919	2.712
Gesamt	1.130.683	1.492.955	54.734	41.375	123.933	46.074	1.242.963	917.525

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

12. Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund		BlackRock ICS US Treasury Fund	
	2022	2021	2022	2021
	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Zahlbare Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer Anteile	309	117	43.386	149
Verzicht auf Managementgebühren	–	–	104	(10.975)
Zahlbare Managementgebühren	267	1.505	2.777	16.073
Noch nicht abgerechnete Käufe von Wertpapieren	4.986	10.000	–	1.199.801
Noch nicht abgerechnete Anteilsrücknahmen	14.074	17.884	52.250	–
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	95	907
Gesamt	19.636	29.506	98.612	1.205.955

13. Genehmigtes

Anteilkapital

Das genehmigte Anteilkapital des Unternehmens setzt sich aus 40.000 Zeichneranteilen mit einem Nennwert von je 1,00 GBP und 500.000.000.000 nennwertlosen, gewinnberechtigten Anteilen zusammen.

Zeichneranteile

Derzeit sind 3 Zeichneranteile ausgegeben, und sie werden zum 30. September 2022 und 30. September 2021 vom Manager und von Nominees des Managers gehalten. Sie gehören nicht zum NIW des Unternehmens. Sie werden im Abschluss somit nur in dieser Anmerkung erwähnt. Nach Auffassung des Verwaltungsrats spiegeln diese Angaben die Art der Anlagetätigkeit des Unternehmens wider.

Stimmrechte

Die Inhaber der Zeichnungsanteile und rückkaufbaren Anteile haben bei schriftlicher Abstimmung eine Stimme je Anteil.

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert

Zum 30. September 2022

		2022	2021	2020
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund¹				
Anteilkategorie Accumulating²				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	801.008	766.794	–
Anteile im Umlauf		80.609.263	76.816.848	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	9,9369	9,9821	–
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund				
Anteilkategorie Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	15.291	22.986	22.021
Anteile im Umlauf		156.986	234.498	223.158
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,4032	98,0222	98,6807
Anteilkategorie Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	9.595	16.543	25.931
Anteile im Umlauf		99.488	170.433	265.127
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	96,4456	97,0668	97,8053
Anteilkategorie G Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	13	13	14
Anteile im Umlauf		14	14	14
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	953,8279	959,9664	966,8271
Anteilkategorie G Accumulating T0				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	10	4.973	12.063
Anteile im Umlauf		101	50.517	121.636
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,7560	98,4394	99,1702
Anteilkategorie Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	373	80	10.297
Anteile im Umlauf		3.820	809	104.027
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,6461	98,2703	98,9807
Anteilkategorie Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	13.938	18.190	28.466
Anteile im Umlauf		142.742	185.100	287.601
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,6458	98,2699	98,9807
Anteilkategorie Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	187	326	97

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Premier (Acc) (Fortsetzung)				
Anteile im Umlauf		1.958	3.394	1.005
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	95,4416	96,0516	96,7466
Anteilklasse Select (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	5	5	5
Anteile im Umlauf		52	49	49
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,7137	98,3178	99,0109
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund				
Anteilklasse Admin III (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	758	893	1.263
Anteile im Umlauf		8.024	9.363	13.108
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	94,5054	95,3853	96,3556
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.614.184	2.996.547	2.871.747
Anteile im Umlauf		26.634.964	30.376.795	28.939.680
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,1485	98,6459	99,2321
Anteilklasse Core (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	58.411	29.065	2.712
Anteile im Umlauf		597.807	295.600	27.386
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,7087	98,3247	99,0276
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	39.592	16.049	14.783
Anteile im Umlauf		410.976	165.551	151.409
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	96,3369	96,9444	97,6374
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	19.711	19.823	–
Anteile im Umlauf		201.454	201.454	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,8417	98,3986	99,0000
Anteilklasse Heritage (Acc)²				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	121.286	146.650	–
Anteile im Umlauf		1.234.840	1.484.624	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,2201	98,7792	–
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.178.746	1.584.780	613.696
Anteile im Umlauf		12.027.663	16.082.841	6.188.721
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,0030	98,5386	99,1637
Anteilklasse Premier (Acc T2)³				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	11	–	–
Anteile im Umlauf		110	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,6691	–	–
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	878.418	424.169	142.394
Anteile im Umlauf		8.949.161	4.297.861	1.433.701
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,1565	98,6929	99,3191
Anteilklasse Select (Acc T0)³				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	–	–
Anteile im Umlauf		2	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,9733	–	–
Anteilklasse Select (Acc)³				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	69	–	–
Anteile im Umlauf		687	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,8808	–	–
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund				
Anteilklasse Admin I (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	–	4.715
Anteile im Umlauf		1	1	47.344
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,0185	99,0185	99,5990
Anteilklasse Admin I (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.353	2.179	2.069
Anteile im Umlauf		14.178	22.676	21.352
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	95,4332	96,1066	96,9025
Anteilklasse Admin II (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.404	2.229	2.771

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Admin II (Acc) (Fortsetzung)				
Anteile im Umlauf		24.394	22.455	27.668
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,5295	99,2745	100,1466
Anteilklasse Admin III (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	–	150
Anteile im Umlauf		3	3	1.503
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,2627	99,2627	99,6114
Anteilklasse Admin III (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	7.668	913	1.519
Anteile im Umlauf		76.538	9.036	14.877
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,1808	101,0903	102,1313
Anteilklasse Admin IV (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	280	310	505
Anteile im Umlauf		3.020	3.295	5.310
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	92,8553	93,9334	95,1382
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.512.351	6.276.697	8.172.403
Anteile im Umlauf		25.586.495	63.615.999	82.329.987
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,1905	98,6654	99,2640
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	161.039	128.241	77.821
Anteile im Umlauf		1.611.524	1.277.135	770.342
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,9295	100,4128	101,0220
Anteilklasse Aon Captives (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	7	8	8
Anteile im Umlauf		68	78	78
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,9804	98,5308	99,1934
Anteilklasse Core (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.800.041	244.382	419.620
Anteile im Umlauf		18.410.717	2.484.437	4.235.139
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,7713	98,3651	99,0806
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	731.850	443.768	542.331
Anteile im Umlauf		5.464.460	3.293.451	3.995.877
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	133,9291	134,7424	135,7226
Anteilklasse G Accumulating T0				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.046.538	2.706.595	2.683.325
Anteile im Umlauf		20.860.906	27.436.961	27.018.134
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,1040	98,6478	99,3157
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	3.405.848	2.655.896	3.595.861
Anteile im Umlauf		34.760.595	26.959.267	36.258.736
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,9802	98,5151	99,1723
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	222.214	233.270	375.082
Anteile im Umlauf		2.270.993	2.371.034	3.787.196
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,8490	98,3832	99,0395
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	22.869.920	22.293.938	28.003.702
Anteile im Umlauf		233.247.856	226.184.690	282.287.333
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,0499	98,5652	99,2028
Anteilklasse Premier (Acc T2)³				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1	–	–
Anteile im Umlauf		10	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,6860	–	–
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.074.812	329.686	797.179
Anteile im Umlauf		10.957.103	3.343.397	8.032.345
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,0927	98,6082	99,2461
Anteilklasse Select (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	84.096	61.382	3.925
Anteile im Umlauf		858.603	623.231	39.581
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,9447	98,4901	99,1570

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Select (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	632.225	61.895	35.339
Anteile im Umlauf		6.555.870	638.269	361.966
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	96,4364	96,9734	97,6300
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund				
Anteilklasse Admin III				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	4.479	2.300	1.303
Anteile im Umlauf		47.003	23.938	13.444
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	95,2943	96,0847	96,9140
Anteilklasse Agency				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.135.626	2.763.372	2.937.084
Anteile im Umlauf		19.511.010	25.144.328	26.607.719
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	109,4575	109,9004	110,3847
Anteilklasse Core				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	1.041	13.317	183
Anteile im Umlauf		9.375	119.204	1.630
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	111,0721	111,7135	112,3966
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	–	–
Anteile im Umlauf		2	2	2
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,8800	99,9800	100,0300
Anteilklasse Heritage				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	21.183	248	–
Anteile im Umlauf		214.139	2.497	1
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	98,9209	99,4158	99,6200
Anteilklasse J (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	105.555	340.708	100.542
Anteile im Umlauf		1.064.859	3.422.256	1.005.162
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,1255	99,5566	100,0252
Anteilklasse J (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	4.821	5.169	4.912
Anteile im Umlauf		48.660	51.949	49.137
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	99,0708	99,5017	99,9701
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	–	–	–
Anteile im Umlauf		1	1	1
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	100,0000	100,0000	100,0000
Anteilklasse Premier				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	2.887.487	3.278.264	1.794.991
Anteile im Umlauf		29.524.467	33.361.572	18.174.048
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,7998	98,2647	98,7667
Anteilklasse Select				
Nettoinventarwert	Tsd. EUR	15.629	3.851	3.640
Anteile im Umlauf		159.837	39.173	36.822
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	97,7826	98,2971	98,8487
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund				
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	789.106	825.917	678.591
Anteile im Umlauf		7.839.897	8.259.456	678.590.659
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,6526	99,9965	1,0000
Anteilklasse Core (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	391.797	458.970	586.807
Anteile im Umlauf		3.897.347	4.590.014	586.806.637
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,5292	99,9931	1,0000
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	7.563	8.398	14.785
Anteile im Umlauf		73.404	81.945	144.263
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	103,0319	102,4825	102,4896
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	694.759	376.951	706.705
Anteile im Umlauf		6.907.534	3.769.771	706.704.892
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,5800	99,9931	1,0000

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	184.397	137.391	179.914
Anteile im Umlauf		1.776.558	1.331.454	1.743.422
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	103,7946	103,1890	103,1961
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	448.023	449.390	857.570
Anteile im Umlauf		4.453.588	4.494.207	857.570.196
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,5981	99,9931	1,0000
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	251.143	122.705	623.244
Anteile im Umlauf		2.436.558	1.197.673	6.082.790
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	103,0730	102,4531	102,4602
Anteilklasse Select (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	9.656	35.941	76.129
Anteile im Umlauf		96.019	359.435	76.128.940
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,5626	99,9931	1,0000
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund				
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	229.997	219.722	15.484
Anteile im Umlauf		2.270.226	2.182.594	153.856
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	101,3102	100,6700	100,6368
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	4.084.207	2.890.825	1.176.793
Anteile im Umlauf		40.880.430	28.905.438	11.766.595
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,9061	100,0097	100,0113
Anteilklasse Core (AccT0)³				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	–	–	–
Anteile im Umlauf		1	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,1500	–	–
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	40.012	2.100	62.008
Anteile im Umlauf		400.507	21.003	620.009
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,9042	100,0055	100,0114
Anteilklasse Heritage (Acc T0)²				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	4.032	10.202	–
Anteile im Umlauf		39.893	101.488	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	101,0770	100,5257	–
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	16.807	442	285
Anteile im Umlauf		166.266	4.394	2.837
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	101,0850	100,5336	100,5286
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	165.177	22.341	7.100
Anteile im Umlauf		1.653.319	223.387	70.992
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,9063	100,0099	100,0115
Anteilklasse J (Acc T3)²				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	821.654	1	–
Anteile im Umlauf		8.167.870	10	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,5959	100,0000	–
Anteilklasse J (Dis T3)²				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1	1	–
Anteile im Umlauf		10	10	–
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,9100	100,0000	–
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.339.737	1.113.569	305.008
Anteile im Umlauf		13.247.587	11.073.779	3.033.269
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	101,1307	100,5591	100,5542
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	727.357	550.931	721.572
Anteile im Umlauf		7.192.060	5.478.540	7.175.751
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	101,1333	100,5617	100,5571
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	667.256	149.055	41.562

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Premier (Dis) (Fortsetzung)				
Anteile im Umlauf		6.684.523	1.491.677	415.931
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,8210	99,9245	99,9261
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund				
Anteilklasse Admin I (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	835	1.144	1.287
Anteile im Umlauf		8.145	11.219	12.619
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	102,5561	101,9735	101,9671
Anteilklasse Admin I (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	600	9.942	–
Anteile im Umlauf		600.002	9.942.402	2
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin II (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	11.570	11.216	11.753
Anteile im Umlauf		108.248	105.502	110.562
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	106,8830	106,3111	106,3048
Anteilklasse Admin II (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.288	15	15
Anteile im Umlauf		1.287.779	14.946	14.946
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin III (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.270	1.179	949
Anteile im Umlauf		11.655	10.866	8.751
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	108,9509	108,4673	108,4605
Anteilklasse Admin III (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	16.311	19.536	10.742
Anteile im Umlauf		16.310.923	19.535.578	10.742.242
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin IV (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.033	1.028	1.047
Anteile im Umlauf		9.585	9.585	9.754
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	107,7457	107,2972	107,2904
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	109.634	121.849	191.969
Anteile im Umlauf		1.003.210	1.123.308	1.770.460
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	109,2831	108,4731	108,4286
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	6.735.948	9.256.182	12.785.220
Anteile im Umlauf		6.735.948.318	9.256.182.014	12.785.219.599
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Aon Captives				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	7.305	2.361	9.840
Anteile im Umlauf		7.304.637	2.360.727	9.840.173
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	415.850	406.391	374.910
Anteile im Umlauf		2.437.460	2.396.412	2.210.905
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	170,6080	169,5832	169,5730
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.351.183	2.144.524	1.740.984
Anteile im Umlauf		1.351.182.688	2.144.523.880	1.740.984.275
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Distributing I				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.739	2.413	3.195
Anteile im Umlauf		1.739.476	2.413.072	3.194.569
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Distributing II				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	–	–	–
Anteile im Umlauf		381	381	381
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	273.015	371.076	438.082
Anteile im Umlauf		2.586.782	3.539.044	4.178.349

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Heritage (Acc) Shares (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,5423	104,8520	104,8456
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	6.085.533	7.988.711	9.247.949
Anteile im Umlauf		6.085.532.706	7.988.710.565	9.247.948.782
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	2.852.527	1.858.159	2.191.681
Anteile im Umlauf		26.956.252	17.678.651	20.853.072
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,8206	105,1075	105,1012
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	14.065.547	12.583.749	12.944.222
Anteile im Umlauf		14.065.547.055	12.583.749.199	12.944.222.313
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse S (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	208.817	245.891	334.626
Anteile im Umlauf		1.992.471	2.362.134	3.214.754
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	104,8033	104,0970	104,0907
Anteilklasse Select (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	30.976	43.513	77.085
Anteile im Umlauf		294.747	416.691	738.229
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	105,0931	104,4254	104,4192
Anteilklasse Select (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	1.338.606	1.564.104	1.445.690
Anteile im Umlauf		1.338.605.799	1.564.104.444	1.445.689.721
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	1,00	1,00	1,00
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund				
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	87.011	294.991	250.682
Anteile im Umlauf		872.036	2.949.851	2.505.561
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,7793	100,0019	100,0504
Anteilklasse Agency				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	520.334	607.098	1.403.200
Anteile im Umlauf		3.842.575	4.504.189	10.432.339
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	135,4128	134,7853	134,5047
Anteilklasse Core				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	7.524	7.992	8.521
Anteile im Umlauf		57.193	60.927	64.984
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	131,5565	131,1709	131,1204
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	–	–	–
Anteile im Umlauf		1	1	1
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,0000	100,0000	100,0000
Anteilklasse Heritage				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	14.099	10.056	12.044
Anteile im Umlauf		139.586	99.929	119.817
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	101,0023	100,6303	100,5162
Anteilklasse J (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	85.013	56.859	3.688
Anteile im Umlauf		843.810	566.815	36.833
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	100,7494	100,3128	100,1340
Anteilklasse J (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	30.721	89.644	105.146
Anteile im Umlauf		307.982	896.721	1.051.277
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,7504	99,9690	100,0174
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	23.337	29.476	56.935
Anteile im Umlauf		233.944	294.849	569.254
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	99,7543	99,9690	100,0175
Anteilklasse Premier				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	834.568	1.046.609	806.253
Anteile im Umlauf		8.020.821	10.098.414	7.790.071
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	104,0502	103,6409	103,4976

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Select				
Nettoinventarwert	Tsd. GBP	19.075	14.894	28.325
Anteile im Umlauf		146.179	114.530	218.008
Nettoinventarwert je Anteil	GBP	130,4913	130,0433	129,9284
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund				
Anteilklasse Agency (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	116.508	64.988	12.278
Anteile im Umlauf		1.135.634	638.585	120.807
Nettoinventarwert je Anteil	USD	102,5925	101,7692	101,6352
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	3.592.897	3.466.923	2.456.877
Anteile im Umlauf		35.931.537	34.654.968	24.554.919
Nettoinventarwert je Anteil	USD	99,9929	100,0412	100,0564
Anteilklasse Core (Acc T0)³				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		1	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	102,4848	–	–
Anteilklasse Core (Acc)²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.008	2.500	–
Anteile im Umlauf		19.668	24.647	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	102,1117	101,4336	–
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	123.521	123.941	17.601
Anteile im Umlauf		1.235.385	1.238.905	175.914
Nettoinventarwert je Anteil	USD	99,9857	100,0410	100,0562
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	37.282	30.471	9.166
Anteile im Umlauf		372.874	304.584	91.604
Nettoinventarwert je Anteil	USD	99,9864	100,0416	100,0569
Anteilklasse Premier (Acc T0)²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	12.206	51.326	–
Anteile im Umlauf		119.276	505.245	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	102,3360	101,5862	–
Anteilklasse Premier (Acc)²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	95.196	89.031	–
Anteile im Umlauf		930.448	876.621	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	102,3115	101,5612	–
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	76.206	103.956	41.745
Anteile im Umlauf		762.165	1.039.125	417.214
Nettoinventarwert je Anteil	USD	99,9861	100,0415	100,0567
Anteilklasse Select (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	10.050	42.036	47.117
Anteile im Umlauf		100.511	420.182	470.899
Nettoinventarwert je Anteil	USD	99,9859	100,0414	100,0567
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund				
Anteilklasse Admin I (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	23.213	60.255	42.068
Anteile im Umlauf		216.837	566.746	395.723
Nettoinventarwert je Anteil	USD	107,0544	106,3174	106,3076
Anteilklasse Admin I (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1	1	1
Anteile im Umlauf		669	669	669
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin II (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	128.105	121.405	115.117
Anteile im Umlauf		1.182.875	1.128.469	1.070.124
Nettoinventarwert je Anteil	USD	108,2997	107,5836	107,5736
Anteilklasse Admin II (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	48.467	59.312	65.504
Anteile im Umlauf		48.467.159	59.311.739	65.504.381
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Admin III (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	27.894	32.455	37.782
Anteile im Umlauf		254.495	297.860	346.780
Nettoinventarwert je Anteil	USD	109,6055	108,9616	108,9515
Anteilklasse Admin III (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	127.033	23.830	36.964
Anteile im Umlauf		127.033.436	23.829.740	36.963.563
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Admin IV (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	33.992	44.284	73.634
Anteile im Umlauf		313.114	409.903	681.636
Nettoinventarwert je Anteil	USD	108,5619	108,0359	108,0259
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	41.129	40.641	60.505
Anteile im Umlauf		376.691	375.459	559.847
Nettoinventarwert je Anteil	USD	109,1848	108,2432	108,0749
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	4.453.050	2.443.689	2.559.700
Anteile im Umlauf		4.453.050.048	2.443.688.895	2.559.699.832
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Aon Captives				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	83.332	340.163	23.795
Anteile im Umlauf		83.332.227	340.163.491	23.794.573
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Core (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	30.025	2.262	2.492
Anteile im Umlauf		295.745	22.441	24.724
Nettoinventarwert je Anteil	USD	101,5247	100,7963	100,7742
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	664.070	627.335	997.163
Anteile im Umlauf		4.304.590	4.095.856	6.511.889
Nettoinventarwert je Anteil	USD	154,2702	153,1632	153,1297
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	9.204.469	9.529.649	11.121.870
Anteile im Umlauf		9.204.469.124	9.529.649.196	11.121.870.467
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Klasse FA				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		100	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Accumulating II				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.065	2.543	2.543
Anteile im Umlauf		1.925	2.387	2.387
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1.072,9596	1.065,5729	1.065,4738
Anteilklasse G Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	148.987	181.682	279.838
Anteile im Umlauf		13.464	16.537	25.477
Nettoinventarwert je Anteil	USD	11.065,7752	10.986,3693	10.983,9619
Anteilklasse G Distributing I				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	7.052	26.064	99.035
Anteile im Umlauf		7.051.544	26.064.019	99.034.976
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Distributing II				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	30
Anteile im Umlauf		209	210	29.630
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	115.970	102.564	341.360
Anteile im Umlauf		115.970.183	102.564.431	341.359.756
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Heritage (Acc)²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	11.046	1	–
Anteile im Umlauf		1.096	–	–

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse G Heritage (Acc)² (Fortsetzung)				
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10.077,5058	10.000,0000	–
Anteilklasse G Heritage (Dis)²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1.984	1	–
Anteile im Umlauf		1.984.000	1.000	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	–
Anteilklasse Heritage (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	21.404	5.783	18.925
Anteile im Umlauf		208.766	56.844	186.125
Nettoinventarwert je Anteil	USD	102,5268	101,7400	101,6783
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	622.550	803.118	1.113.904
Anteile im Umlauf		5.737.485	7.458.867	10.351.544
Nettoinventarwert je Anteil	USD	108,5058	107,6729	107,6075
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	12.753.662	9.111.067	11.358.390
Anteile im Umlauf		12.753.662.010	9.111.066.559	11.358.390.074
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Klasse N				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	75.645	98.613	66.453
Anteile im Umlauf		75.645.421	98.613.064	66.452.752
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Premier (Acc T0)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	3.518.665	4.847.701	4.314.075
Anteile im Umlauf		34.286.253	47.613.883	42.408.967
Nettoinventarwert je Anteil	USD	102,6261	101,8128	101,7255
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	3.423.343	2.301.246	2.454.198
Anteile im Umlauf		31.561.066	21.385.524	22.826.465
Nettoinventarwert je Anteil	USD	108,4673	107,6076	107,5154
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	26.256.604	25.808.294	19.250.450
Anteile im Umlauf		26.256.600.880	25.808.294.258	19.250.449.791
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Select (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	187.068	171.534	301.051
Anteile im Umlauf		1.729.965	1.598.230	2.806.059
Nettoinventarwert je Anteil	USD	108,1337	107,3272	107,2861
Anteilklasse Select (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1.977.789	1.103.570	739.799
Anteile im Umlauf		1.977.788.998	1.103.570.028	739.799.289
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund				
Anteilklasse Agency				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	2.100.952	465.134	85.993
Anteile im Umlauf		18.943.634	4.223.859	782.955
Nettoinventarwert je Anteil	USD	110,9054	110,1207	109,8317
Anteilklasse Core³				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	10.057	–	–
Anteile im Umlauf		99.793	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,7742	–	–
Heritage (CHF Hedged) Share³				
Nettoinventarwert	Tsd. CHF	8.451	–	–
Anteile im Umlauf		85.323	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	CHF	99,0456	–	–
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		1	1	1
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0000	100,0000	100,0000
Anteilklasse Heritage (SGD Hedged)²				
Nettoinventarwert	Tsd. SGD	23.762	12.412	–
Anteile im Umlauf		235.911	124.056	–
Nettoinventarwert je Anteil	SGD	100,7226	100,0477	–

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse Heritage				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	761.644	2.486	17.829
Anteile im Umlauf		7.286.698	23.926	171.920
Nettoinventarwert je Anteil	USD	104,5252	103,8851	103,7072
Anteilklasse J (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	238.006	573.180	159.857
Anteile im Umlauf		2.354.965	5.710.051	1.596.277
Nettoinventarwert je Anteil	USD	101,0658	100,3809	100,1438
Anteilklasse J (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	22.544	87.126	89.407
Anteile im Umlauf		226.135	872.093	894.661
Nettoinventarwert je Anteil	USD	99,6935	99,9047	99,9335
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	17.571	44.584	23.549
Anteile im Umlauf		175.696	444.866	234.912
Nettoinventarwert je Anteil	USD	100,0063	100,2184	100,2473
Anteilklasse Premier				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	758.528	1.069.239	503.302
Anteile im Umlauf		6.923.778	9.822.560	4.632.673
Nettoinventarwert je Anteil	USD	109,5541	108,8554	108,6417
Anteilklasse Select				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	412.786	808.566	596.261
Anteile im Umlauf		3.694.157	7.278.895	5.375.546
Nettoinventarwert je Anteil	USD	111,7403	111,0836	110,9209
BlackRock ICS US Treasury Fund				
Anteilklasse Admin III (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	11.198	17.719	6.850
Anteile im Umlauf		11.197.933	17.718.594	6.849.625
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Agency (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	21.285	7.149	2.787
Anteile im Umlauf		199.130	67.372	26.283
Nettoinventarwert je Anteil	USD	106,8922	106,1111	106,0551
Anteilklasse Agency (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	627.069	494.377	432.273
Anteile im Umlauf		627.069.203	494.376.650	432.273.189
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Core (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	173.465	169.066	136.109
Anteile im Umlauf		1.638.433	1.606.815	1.293.683
Nettoinventarwert je Anteil	USD	105,8727	105,2182	105,2105
Anteilklasse Core (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	8.618.565	8.633.814	6.539.863
Anteile im Umlauf		8.618.565.001	8.633.814.455	6.539.863.429
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Klasse FA				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		100	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Accumulating				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1.414	–	–
Anteile im Umlauf		138	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10.245,5133	10.197,0000	10.197,0000
Anteilklasse G Distributing				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	581	–	–
Anteile im Umlauf		581.110	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse G Heritage (Acc)²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	5.793	1	–
Anteile im Umlauf		575	–	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	10.072,6184	10.000,0000	–
Anteilklasse G Heritage (Dis)²				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	708	1	–

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

14. Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert (Fortsetzung)

		2022	2021	2020
BlackRock ICS US Treasury Fund (Fortsetzung)				
Anteilklasse G Heritage (Dis)¹ (Fortsetzung)				
Anteile im Umlauf		708.000	1.000	–
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	–
Anteilklasse Heritage (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	31.191	26.157	70.326
Anteile im Umlauf		294.435	248.562	668.382
Nettoinventarwert je Anteil	USD	105,9341	105,2349	105,2189
Anteilklasse Heritage (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	1.546.466	1.575.801	3.374.349
Anteile im Umlauf		1.546.465.776	1.575.800.701	3.374.349.201
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Klasse N				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	–	–	–
Anteile im Umlauf		100	100	100
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Premier (Acc)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	304.282	84.320	200.707
Anteile im Umlauf		2.860.849	798.158	1.900.264
Nettoinventarwert je Anteil	USD	106,3609	105,6429	105,6201
Anteilklasse Premier (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	9.683.767	6.359.609	9.932.886
Anteile im Umlauf		9.683.765.666	6.359.609.162	9.932.886.093
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00
Anteilklasse Select (Dis)				
Nettoinventarwert	Tsd. USD	495.887	391.483	585.160
Anteile im Umlauf		495.887.056	391.482.901	585.159.630
Nettoinventarwert je Anteil	USD	1,00	1,00	1,00

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

²Die Anteilklasse wurde während des vorherigen Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

³Die Anteilklasse wurde während des Geschäftsjahres aufgelegt. Daher liegen keine Vergleichsdaten vor.

15. Wechselkurse

Zum 30. September 2022 und zum 30. September 2021 galten folgende Wechselkurse:

	30. September 2022	30. September 2021
EUR = 1		
CAD	1,3461	1,4682
GBP	0,8776	0,8595
USD	0,9796	1,1589
GBP = 1		
CAD	1,5339	1,7082
EUR	1,1395	1,1634
USD	1,1163	1,3483
USD = 1		
CAD	1,3741	1,2669
CHF	0,9843	0,9329
EUR	1,0208	0,8629
SGD	1,4349	1,3576

Die durchschnittlichen Wechselkurse am Ende des Geschäftsjahres waren:

	30. September 2022	30. September 2021
GBP = 1		
EUR	1,1805	1,1454
USD	1,2804	1,3688

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

16. 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.

Die folgenden Unternehmen waren im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 dem Unternehmen nahestehende Parteien:

Verwaltungsrat des Unternehmens	
Verwaltungsgesellschaft:	BlackRock Asset Management Ireland Limited
Investmentmanager und Hauptvertriebsgesellschaft:	BlackRock Investment Management (UK) Limited
US-Investmentmanager:	BlackRock Capital Management, Inc.
Unter-Investmentmanager:	BlackRock Investment Management (UK) Limited.
Vertreter in Dänemark:	BlackRock Copenhagen Branch
Vertreter in Südafrika:	BlackRock Investment Management (UK) Limited (Zweigniederlassung Südafrika)
Vertreter in der Schweiz:	BlackRock Asset Management Schweiz AG

Die übergeordnete Holdinggesellschaft der Verwaltungsgesellschaft, des Anlageverwalters, der Hauptvertriebsgesellschaft, des US-Anlageverwalters, des Unter-Anlageverwalters und des Vertreters in Dänemark, Südafrika und der Schweiz ist die BlackRock Inc., ein in Delaware, USA, gegründetes Unternehmen.

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

Name des Fonds	Unter-Investmentmanager
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	BlackRock Investment Management (UK) Limited
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	
BlackRock ICS US Treasury Fund	

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

Die an die Verwaltungsgesellschaft und den Investmentmanager im Laufe des Geschäftsjahres gezahlten Gebühren, die Natur dieser Transaktionen und die zum Ende des Geschäftsjahres offenen Salden finden sich jeweils in den Anmerkungen 6 und 12. Für den BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund, den BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund, den BlackRock ICS Euro Liquidity Fund, den BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund, den BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund, den BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund, den BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund, den BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund und den BlackRock ICS US Treasury Fund wurde wie in Anmerkung 6 angegeben auf eine Managementgebühr verzichtet.

Die Verwaltungsratsmitglieder zum 30. September 2022 sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

Verwaltungsratsmitglieder	Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe	Verwaltungsratsmitglied bei verbundenen Unternehmen von BlackRock und/oder von BlackRock verwalteten Fonds
Barry O'Dwyer	Nein	Ja
Jacqueline Flynn	Ja	Ja
Nicola Grenham	Nein	Ja
Becky Tilston Hales	Ja	Ja
Tom McGrath	Ja	Ja
Karen Prooth	Ja	Ja

Die Verwaltungsratsgehälter sind in der gesetzlich vorgeschriebenen Anmerkung zum Jahresabschluss offen gelegt. Die Gesamtbezüge der Verwaltungsratsmitglieder beziehen sich auf Dienstleistungen, die sie als Verwaltungsratsmitglieder erbracht haben. Die Verwaltungsratsmitglieder, die ebenfalls Mitarbeiter der BlackRock-Gruppe sind, haben keinen Anspruch auf eine Vergütung für Verwaltungsratsmitglieder.

Anteile an anderen Fonds, die 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
Investmentgesellschaft - in Irland von der CBI zugelassene OGAW	
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc TO) Shares	Jahresaufwand auf 0,03 % des NIW begrenzt ¹
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares	Jahresaufwand auf 0,03 % des NIW begrenzt ¹
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares	Jahresaufwand auf 0,03 % des NIW begrenzt ¹

¹Die 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.

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

16. Transaktionen mit nahestehenden Parteien (Fortsetzung)

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 20 % oder mehr der im Umlauf befindlichen stimmberechtigten Anteile des Unternehmens gehalten haben und demzufolge als dem Unternehmen nahestehende Parteien gelten („bedeutende Anleger“).

Zum 30. September 2022

Name des Fonds	Gesamtanteil der von BlackRock nahestehenden Anlegern gehaltenen Anteile in %	Gesamtanteil der von bedeutenden Anlegern, die keine nahestehenden Anleger von BlackRock sind, gehaltenen Anteile in %	Anzahl der bedeutenden Anleger, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	null	99,12	1
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	0,01	88,63	3
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	4,44	null	null
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	0,18	null	null
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	–1	null	null
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	–1	null	null
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	0,59	null	null
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1,35	null	null
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	–1	37,40	1
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	2,00	null	null
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	0,04	null	null
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	–1	65,03	2
BlackRock ICS US Treasury Fund	–1	null	null

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

Zum 30. September 2021

Name des Fonds	Gesamtanteil der von BlackRock nahestehenden Anlegern gehaltenen Anteile in %	Gesamtanteil der von bedeutenden Anlegern, die keine nahestehenden Anleger von BlackRock sind, gehaltenen Anteile in %	Anzahl der bedeutenden Anleger, die keine BlackRock nahestehenden Anleger sind
BlackRock Euro Ultra Short Core Bond Fund	null	98,95	1
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	6,67	53,03	2
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	0,42	null	null
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	0,76	null	null
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	–1	null	null
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	–1	null	null
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	–1	null	null
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	–1	null	null
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	–1	22,32	1
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	–1	null	null
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	–1	null	null
BlackRock ICS US Treasury Fund	–1	null	null

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

Die Fonds haben zum Ende des Geschäftsjahres keine Rückstellungen für Forderungen gegenüber nahestehenden Parteien erfasst (30. September 2021: null).

Es wurden im Geschäftsjahr keine Abschreibungen für Forderungen oder Verbindlichkeiten gegenüber nahestehenden Parteien vorgenommen (30. September 2021: null).

Es wurden im Geschäftsjahr gegenüber nahestehenden Parteien keine besicherten oder unbesicherten Verpflichtungen oder Garantien eingegangen (30. September 2021: null).

NM0223U-2714371-73/244

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)

17. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 30. September 2022 und 30. September 2021 bestanden keine wesentlichen Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

18. Gesetzlich vorgeschriebene Angaben

Die folgenden Gebühren waren in den Managementgebühren für das Geschäftsjahr enthalten:

	2022 Tsd. EUR	2021 Tsd. EUR
Honorar der Verwaltungsratsmitglieder	61	60
Prüfungsgebühren (einschließlich Kosten) im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses	109	109
Nicht prüfungsbezogene Gebühren	null	null

Die Honorare der Verwaltungsratsmitglieder wird die Summe von 50.000 GBP jährlich je Verwaltungsratsmitglied ohne Genehmigung des Verwaltungsrates nicht überschreiten. Es wurden außer den obigen Prüfungsgebühren an Ernst & Young in Dublin, Irland, als Abschluss- und Berichtsprüfer des Unternehmens keine weiteren Honorare für Bewertungs-, Steuerberatungs- und sonstige Beratungsleistungen oder nicht prüfungsbezogene Gebühren gezahlt, da keine weiteren Leistungen erbracht wurden.

19. Ereignisse nach dem Stichtag

Am 1. November 2022 wurden für den BlackRock ICS Euro Liquidity Fund die Anteilklassen Heritage (Dis) und Premier (Dis) aufgelegt.

Am 7. November 2022 wurden für den BlackRock ICS Euro Liquidity Fund die Anteilklassen Core (Dis), Agency (Dis) und Select (Dis) aufgelegt.

Am 7. November 2022 wurden für den BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund die Anteilklassen Core (Dis) und Premier (Dis) aufgelegt.

Am 9. Januar 2023 wurde der Vertrag mit der Steubing AG International AG als Listing Agent in Deutschland gekündigt, da das Erfordernis eines lokalen Vertreters in der Richtlinie über den grenzüberschreitenden Fondsvertrieb („Cross Border Distribution of Funds Directive“) aufgehoben wurde.

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 30. September 2022 beendete Geschäftsjahr ausgewirkt haben könnten.

20. Genehmigungsdatum

Am 26. Januar 2023 wurde der Halbjahresabschluss vom Verwaltungsrat genehmigt.

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2021: 11,76 %)				
15.000.000	EUR	Kanada (30. September 2021: 0,00 %) Toronto-Dominion Bank (The), 0.72%, 09/06/2023 ¹	14.795	1,85
		Kanada - Gesamt	14.795	1,85
12.000.000	EUR	Frankreich (30. September 2021: 0,00 %) Credit Agricole SA, 0.32%, 08/11/2022 ¹	11.989	1,50
		Frankreich - Gesamt	11.989	1,50
5.000.000	EUR	Irland (30. September 2021: 1,96 %) Hewlett-packard International Bank DAC, 0.02%, 03/10/2022 ¹	5.000	0,62
		Irland - Gesamt	5.000	0,62
12.000.000	EUR	Japan (30. September 2021: 2,61 %) MUFG Bank Ltd., 0.32%, 01/11/2022 ¹	11.992	1,50
10.000.000	EUR	Norinchukin Bank (The), 0.69%, 17/10/2022 ¹	9.997	1,25
5.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.58%, 21/10/2022 ¹	4.998	0,62
		Japan - Gesamt	26.987	3,37
5.000.000	EUR	Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 7,19 %) Goldman Sachs International Bank, 0.15%, 25/04/2023 ¹	4.944	0,62
20.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 0.72%, 01/02/2023 ¹	19.897	2,48
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	24.841	3,10
Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt			83.612	10,44
Commercial Papers (30. September 2021: 28,80 %)				
19.000.000	CAD	Kanada (30. September 2021: 2,22 %) Enbridge Gas, Inc., 3.14%, 07/10/2022 ¹	14.110	1,76
		Kanada - Gesamt	14.110	1,76
15.000.000	EUR	Frankreich (30. September 2021: 2,29 %) Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 07/10/2022 ¹	14.998	1,88
20.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 1.01%, 16/12/2022 ¹	19.961	2,49
		Frankreich - Gesamt	34.959	4,37
12.000.000	EUR	Deutschland (30. September 2021: 4,71 %) DZ Bank AG, 0.64%, 02/02/2023 ¹	11.944	1,49
30.000.000	EUR	RWE AG, 0.88%, 19/10/2022 ¹	29.983	3,75
		Deutschland - Gesamt	41.927	5,24
20.000.000	EUR	Japan (30. September 2021: 0,00 %) Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.87%, 16/11/2022 ¹	19.976	2,49
		Japan - Gesamt	19.976	2,49
3.000.000	EUR	Luxemburg (30. September 2021: 0,00 %) DH Europe Finance II SARL, 0.82%, 03/11/2022 ¹	2.998	0,37
		Luxemburg - Gesamt	2.998	0,37
10.000.000	EUR	Niederlande (30. September 2021: 2,61 %) BMW Finance NV, 0.26%, 13/10/2022 ¹	9.997	1,25
18.000.000	EUR	Universal Music Group NV, 0.65%, 06/10/2022 ¹	17.999	2,25
5.000.000	EUR	Universal Music Group NV, 0.89%, 24/10/2022 ¹	4.997	0,62

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Niederlande (Fortsetzung)				
4.000.000	EUR	Universal Music Group NV, 0.91%, 28/10/2022 ¹	3.997	0,50
		Niederlande - Gesamt	36.990	4,62
Spanien (30. September 2021: 2,61 %)				
7.000.000	EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.60%, 27/10/2022 ¹	6.996	0,87
		Spanien - Gesamt	6.996	0,87
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 9,79 %)				
15.000.000	EUR	Amcory UK Finance plc, 0.44%, 28/10/2022 ¹	14.989	1,87
25.000.000	EUR	Barclays Bank plc, 0.96%, 05/05/2023	25.007	3,12
25.000.000	EUR	Brambles Finance plc, 0.34%, 26/10/2022 ¹	24.980	3,12
11.000.000	EUR	Brambles Finance plc, 0.48%, 01/11/2022 ¹	10.989	1,37
16.000.000	EUR	National Grid plc, 0.94%, 24/10/2022 ¹	15.992	2,00
16.000.000	EUR	National Grid plc, 0.95%, 28/10/2022 ¹	15.991	2,00
12.000.000	EUR	NTT Finance UK Ltd., 0.81%, 11/10/2022 ¹	11.997	1,50
11.000.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 0.90%, 02/02/2023 ¹	10.943	1,36
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	130.888	16,34
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 4,57 %)				
20.000.000	EUR	Avery Dennison Corp., 0.73%, 07/10/2022 ¹	19.997	2,50
10.000.000	EUR	Collateralized Commercial Paper III Co. LLC, 0.67%, 25/01/2023 ¹	9.954	1,24
10.000.000	EUR	Danaher Corp., 1.07%, 16/11/2022 ¹	9.988	1,25
35.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 3.55%, 28/10/2022 ¹	35.631	4,45
19.000.000	EUR	Fisvec, 0.88%, 03/11/2022 ¹	18.983	2,37
20.000.000	EUR	Hewlett Packard Enterprise Co., 0.85%, 24/10/2022 ¹	19.990	2,49
18.000.000	EUR	Realty Income Corp., 0.90%, 19/10/2022 ¹	17.990	2,24
21.000.000	EUR	Realty Income Corp., 0.92%, 09/11/2022 ¹	20.973	2,62
		Vereinigte Staaten - Gesamt	153.506	19,16
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			442.350	55,22
Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 59,11 %)				
Australien (30. September 2021: 2,40 %)				
30.000.000	EUR	Macquarie Bank Ltd., FRN, 0.95%, 20/10/2023	30.146	3,76
		Australien - Gesamt	30.146	3,76
Kanada (30. September 2021: 2,62 %)				
			-	-
Finnland (30. September 2021: 0,00 %)				
13.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, FRN, 1.34%, 17/05/2024	13.126	1,64
		Finnland - Gesamt	13.126	1,64
Frankreich (30. September 2021: 13,22 %)				
8.200.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.50%, 16/11/2022	8.192	1,02
3.000.000	EUR	BNP Paribas SA, 1.13%, 15/01/2023	2.996	0,37
6.300.000	EUR	Credit Agricole SA, 3.15%, 23/12/2023	6.328	0,79
20.000.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.60%, 20/03/2023	19.876	2,48
15.000.000	EUR	HSBC Continental Europe SA, FRN, 2.17%, 28/06/2024	15.135	1,89

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
8.800.000	EUR	Frankreich (Fortsetzung) Societe Generale SA, 0.75%, 26/05/2023	8.713	1,09
		Frankreich - Gesamt	61.240	7,64
		Deutschland (30. September 2021: 2,63 %)	-	-
		Irland (30. September 2021: 0,67 %)	-	-
		Japan (30. September 2021: 0,13 %)	-	-
7.396.000	EUR	Luxemburg (30. September 2021: 1,10 %) John Deere Bank SA, FRN, 0.09%, 03/10/2022	7.396	0,92
		Luxemburg - Gesamt	7.396	0,92
8.700.000	EUR	Niederlande (30. September 2021: 16,36 %) ABN AMRO Bank NV, 2.50%, 29/11/2023	8.678	1,08
8.464.000	EUR	BMW Finance NV, 0.50%, 22/11/2022	8.446	1,06
20.000.000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.00%, 20/02/2023	19.840	2,48
5.000.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.63%, 26/09/2023	4.898	0,61
20.000.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 1.20%, 24/05/2023	20.065	2,51
		Niederlande - Gesamt	61.927	7,74
5.000.000	EUR	Neuseeland (30. September 2021: 1,97 %) BNZ International Funding Ltd., 0.50%, 13/05/2023	4.939	0,62
		Neuseeland - Gesamt	4.939	0,62
14.000.000	EUR	Norwegen (30. September 2021: 0,00 %) DNB Bank ASA, 0.05%, 14/11/2023	13.544	1,69
		Norwegen - Gesamt	13.544	1,69
6.000.000	EUR	Schweden (30. September 2021: 4,47 %) SBAB Bank AB, 0.75%, 14/06/2023	5.930	0,74
13.100.000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.50%, 13/03/2023	13.012	1,62
		Schweden - Gesamt	18.942	2,36
13.575.000	EUR	Schweiz (30. September 2021: 4,51 %) Credit Suisse AG, FRN, 1.62%, 01/09/2023	13.585	1,70
17.350.000	EUR	Credit Suisse AG, FRN, 1.81%, 31/05/2024	17.401	2,17
		Schweiz - Gesamt	30.986	3,87
5.000.000	EUR	Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 1,67 %) Motability Operations Group plc, 1.63%, 09/06/2023	4.947	0,62
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	4.947	0,62
21.000.000	EUR	Vereinigte Staaten (30. September 2021: 7,36 %) American Honda Finance Corp., 1.38%, 10/11/2022	20.987	2,62

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen		Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts	
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)						
		Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
3.900.000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 2.38%, 11/01/2023		3.906	0,49	
		Vereinigte Staaten - Gesamt		24.893	3,11	
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt				272.086	33,97	
Anlagen in Anleihen - Gesamt				272.086	33,97	
Beschreibung		Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts	
Devisenterminkontrakte²						
Buy EUR 14,584,220; Sell CAD 19,000,000		HSBC	07.10.2022	472	0,06	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2021: 0,00 %)				472	0,06	
Devisenterminkontrakte²						
Buy EUR 301,629; Sell USD 308,000		Barclays	28.10.2022	(12)	–	
Buy EUR 33,974,363; Sell USD 34,692,000		HSBC	28.10.2022	(1.379)	(0,18)	
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2021: (0,04) %)				(1.391)	(0,18)	
Anzahl der Kontrakte	Währung	Nennwert	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Terminkontrakte (Futures)						
Deutschland (30. September 2021: 0,00 %)						
(512)	EUR	(51.200.000)	Euro-Schatz	08.12.2022	463	0,06
Deutschland - Gesamt					463	0,06
Schweiz (30. September 2021: 0,01 %)						
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) - Gesamt (30. September 2021: 0,01 %)					463	0,06
				Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts	
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt				798.983	99,75	
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt				(1.391)	(0,18)	
Zahlungsmittel und Bareinschüsse				2.377	0,30	
Zahlungsmitteläquivalente						
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				1.039	0,13	
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert				801.008	100,00	

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

	% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	33,88
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)	65,50
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,06
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,06
Sonstige Vermögenswerte	0,50
Gesamtvermögen	<u>100,00</u>

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

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.

	Basisengagement TSD. EUR
Derivative Finanzinstrumente	
Devisenterminkontrakte	49.842
Terminkontrakte (Futures)	54.868

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen		Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts	
ANLEIHEN						
Staatsanleihen (30. September 2021: 78,96 %)						
1.500.000	EUR	Österreich (30. September 2021: 4,76 %) Austria Treasury Bill, 0.36%, 20/10/2022 ¹		1.500	3,81	
		Österreich - Gesamt		1.500	3,81	
10.600.000	EUR	Frankreich (30. September 2021: 65,32 %) France Treasury Bill BTF, 0.16%, 05/10/2022 ¹		10.600	26,90	
5.550.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.18%, 12/10/2022 ¹		5.549	14,08	
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, (0.04)%, 19/10/2022 ¹		100	0,25	
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.03%, 26/10/2022 ¹		100	0,25	
100.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.26%, 02/11/2022 ¹		100	0,25	
200.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.38%, 09/11/2022 ¹		200	0,51	
50.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.50%, 16/11/2022 ¹		50	0,13	
		Frankreich - Gesamt		16.699	42,37	
		Deutschland (30. September 2021: 8,88 %)		-	-	
1.500.000	EUR	Niederlande (30. September 2021: 0,00 %) Dutch Treasury Certificate, 0.33%, 28/10/2022 ¹		1.500	3,80	
		Niederlande - Gesamt		1.500	3,80	
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt				19.699	49,98	
Anlagen in Anleihen - Gesamt				19.699	49,98	
Bestand	Währung	Kontrahent	Zins- sätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (30. September 2021: 12,67 %)						
Kanada (30. September 2021: 12,67 %)						
5.500.000	EUR	Bank of Nova Scotia plc	(0,25) %	03.10.2022	5.500	13,95
		Kanada - Gesamt			5.500	13,95
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 0,00 %)						
5.000.000	EUR	BNP Paribas SA	(0,35) %	03.10.2022	5.000	12,69
		Vereinigtes Königreich - Gesamt			5.000	12,69
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,00 %)						
5.500.000	EUR	BofA Securities Europe SA	(0,38) %	03.10.2022	5.500	13,96
		Vereinigte Staaten - Gesamt			5.500	13,96
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					16.000	40,60

BLACKROCK ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	35.699	90,58
Barmittel und Barsicherheiten	3.720	9,44
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(7)	(0,02)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	39.412	100,00

	% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	49,97
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	40,59
Sonstige Vermögenswerte	9,44
Gesamtvermögen	100,00

¹ Die Zinssätze sind Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

² Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 16.447.000 EUR.

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2021: 21,88 %)				
Belgien (30. September 2021: 0,77 %)				
35.000.000	EUR	KBC Bank NV, 0.51%, 03/01/2023 ¹	34.879	0,71
		Belgien - Gesamt	34.879	0,71
Kanada (30. September 2021: 0,00 %)				
94.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.96%, 14/07/2023	93.397	1,90
50.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.96%, 21/07/2023	49.651	1,01
		Kanada - Gesamt	143.048	2,91
Finnland (30. September 2021: 2,11 %)				
75.000.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.13%, 24/10/2022 ¹	74.969	1,52
24.500.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.27%, 03/01/2023 ¹	24.432	0,50
24.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.26%, 03/01/2023 ¹	23.925	0,49
2.500.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 1.59%, 09/03/2023 ¹	2.482	0,05
		Finnland - Gesamt	125.808	2,56
Frankreich (30. September 2021: 4,13 %)				
20.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.33%, 01/11/2022 ¹	19.986	0,41
100.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.32%, 07/11/2022 ¹	99.914	2,03
20.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.34%, 08/11/2022 ¹	19.982	0,41
37.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.99%, 02/12/2022 ¹	36.929	0,75
		Frankreich - Gesamt	176.811	3,60
Deutschland (30. September 2021: 1,02 %)				
			-	-
Japan (30. September 2021: 4,79 %)				
36.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.75%, 19/10/2022 ¹	35.986	0,73
10.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.21%, 03/11/2022 ¹	9.993	0,20
16.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.38%, 18/11/2022 ¹	15.979	0,33
18.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.27%, 03/01/2023 ¹	17.938	0,37
13.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.28%, 03/01/2023 ¹	12.955	0,26
10.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.50%, 03/01/2023 ¹	9.965	0,20
6.500.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.28%, 03/01/2023 ¹	6.478	0,13
20.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.63%, 19/10/2022 ¹	19.992	0,41
35.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.76%, 02/11/2022 ¹	34.976	0,71
20.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.31%, 04/11/2022 ¹	19.985	0,41
50.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.31%, 07/11/2022 ¹	49.957	1,02
40.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.38%, 18/11/2022 ¹	39.948	0,81
50.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 1.00%, 05/12/2022 ¹	49.898	1,02
		Japan - Gesamt	324.050	6,60
Schweiz (30. September 2021: 5,51 %)				
			-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 2,40 %)				
20.000.000	EUR	Barclays Bank plc, 0.77%, 09/02/2023 ¹	19.887	0,40
30.000.000	EUR	Mizuho International plc, 0.64%, 21/10/2022 ¹	29.987	0,61
20.000.000	EUR	Mizuho International plc, 0.32%, 07/11/2022 ¹	19.983	0,41
7.500.000	EUR	Mizuho International plc, 1.52%, 03/03/2023 ¹	7.446	0,15
10.000.000	EUR	Mizuho International plc, 1.74%, 10/03/2023 ¹	9.923	0,20
5.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, (0.47)%, 26/10/2022 ¹	4.997	0,10
100.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 0.74%, 01/02/2023 ¹	99.487	2,03
70.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 1.04%, 04/08/2023	69.990	1,43
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	261.700	5,33

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 1,15 %)			-	-
Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt			1.066.296	21,71
Commercial Papers (30. September 2021: 38,77 %)				
Belgien (30. September 2021: 0,96 %)			-	-
Finnland (30. September 2021: 1,92 %)				
4.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 1.59%, 06/03/2023 ¹	3.972	0,08
Finnland - Gesamt			3.972	0,08
Frankreich (30. September 2021: 12,55 %)				
15.000.000	EUR	Antalis SA, 0.47%, 05/10/2022 ¹	14.998	0,31
68.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 19/10/2022 ¹	67.969	1,38
40.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 27/10/2022 ¹	39.974	0,81
40.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 31/10/2022 ¹	39.970	0,81
74.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, (0.01)%, 07/10/2022 ¹	73.990	1,51
60.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.42%, 05/12/2022 ¹	59.877	1,22
20.000.000	EUR	BPCE SA, 0.34%, 09/11/2022 ¹	19.983	0,41
80.000.000	EUR	BPCE SA, 0.83%, 03/01/2023	79.732	1,62
15.000.000	EUR	CA Consumer Finance SA, 0.72%, 03/10/2022 ¹	14.999	0,31
50.000.000	EUR	CA Consumer Finance SA, 0.72%, 04/10/2022 ¹	49.996	1,02
15.000.000	EUR	CA Consumer Finance SA, 0.73%, 10/10/2022 ¹	14.998	0,31
200.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 0.63%, 06/10/2022 ¹	199.980	4,07
38.000.000	EUR	Satellite, 0.75%, 21/10/2022 ¹	37.981	0,77
10.000.000	EUR	Satellite, 0.44%, 31/10/2022 ¹	9.993	0,20
28.000.000	EUR	Societe Generale SA, 0.81%, 03/01/2023	27.906	0,57
Frankreich - Gesamt			752.346	15,32
Deutschland (30. September 2021: 7,04 %)				
60.000.000	EUR	DZ Bank AG, 0.65%, 02/02/2023 ¹	59.719	1,21
75.000.000	EUR	SAP SE, 0.31%, 04/11/2022 ¹	74.943	1,53
Deutschland - Gesamt			134.662	2,74
Irland (30. September 2021: 2,87 %)				
15.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.47%, 05/10/2022 ¹	14.998	0,31
50.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 19/10/2022 ¹	49.977	1,02
10.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 24/10/2022 ¹	9.994	0,20
57.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 26/10/2022 ¹	56.965	1,16
10.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.90%, 15/11/2022 ¹	9.987	0,20
5.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.92%, 16/11/2022 ¹	4.994	0,10
20.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 1.22%, 06/01/2023 ¹	19.931	0,41
133.000.000	EUR	Weinberg Capital DAC, 0.83%, 01/11/2022 ¹	132.896	2,71
15.000.000	EUR	Weinberg Capital DAC, 0.83%, 01/11/2022 ¹	14.988	0,30
Irland - Gesamt			314.730	6,41
Luxemburg (30. September 2021: 2,48 %)			-	-
Niederlande (30. September 2021: 0,38 %)			-	-
Schweden (30. September 2021: 8,04 %)				
45.000.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.01%, 24/10/2022 ¹	44.981	0,92
34.000.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.50%, 03/01/2023 ¹	33.909	0,69
6.000.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.52%, 03/01/2023 ¹	5.984	0,12
Schweden - Gesamt			84.874	1,73

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
		Schweiz (30. September 2021: 0,06 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 2,43 %)		
200.000.000	EUR	Barclays Bank plc, 0.29%, 04/11/2022 ¹	199.848	4,07
5.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, (0.47)%, 12/10/2022 ¹	4.999	0,10
5.500.000	EUR	Standard Chartered Bank, 0.90%, 20/02/2023 ¹	5.465	0,11
20.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 1.37%, 01/03/2023 ¹	19.859	0,41
35.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 1.47%, 06/03/2023 ¹	34.742	0,71
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	264.913	5,40
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,04 %)		
41.300.000	EUR	Colgate-Palmolive Co., 0.71%, 11/10/2022 ¹	41.292	0,84
34.998.000	EUR	Mont Blanc Capital Corp., (0.06)%, 13/10/2022 ¹	34.989	0,71
8.225.000	EUR	Mont Blanc Capital Corp., 1.07%, 12/12/2022 ¹	8.206	0,17
		Vereinigte Staaten - Gesamt	84.487	1,72
		Anlagen in Commercial Papers - Gesamt	1.639.984	33,40
		Termineinlagen (30. September 2021: 29,94 %)		
		Österreich (30. September 2021: 0,00 %)		
379.999.781	EUR	Erste Group Bank AG, 0.68%, 03/10/2022	380.000	7,74
		Österreich - Gesamt	380.000	7,74
		Belgien (30. September 2021: 0,25 %)		
360.000.000	EUR	KBC Bank NV, 0.68%, 03/10/2022	360.000	7,33
		Belgien - Gesamt	360.000	7,33
		Kanada (30. September 2021: 4,79 %)		
150.000.000	EUR	Bank of Nova Scotia (The), 0.60%, 03/10/2022	150.000	3,05
		Kanada - Gesamt	150.000	3,05
		Frankreich (30. September 2021: 15,33 %)		
100.000.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.60%, 03/10/2022	100.000	2,03
199.854.605	EUR	BRED Banque Populaire, 0.63%, 03/10/2022	199.854	4,07
100.000.000	EUR	Societe Generale SA, 0.55%, 03/10/2022	100.000	2,04
		Frankreich - Gesamt	399.854	8,14
		Deutschland (30. September 2021: 0,00 %)		
350.000.000	EUR	DZ Bank AG, 0.60%, 03/10/2022	350.000	7,13
		Deutschland - Gesamt	350.000	7,13
		Japan (30. September 2021: 2,88 %)		
200.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.63%, 03/10/2022	200.000	4,07
		Japan - Gesamt	200.000	4,07
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 6,69 %)	-	-
		Anlagen in Termineinlagen - Gesamt	1.839.854	37,46

BLACKROCK ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 4,25 %)				
Luxemburg (30. September 2021: 3,64 %)				
120.000.000	EUR	Purple Protected Asset, FRN, 0.69%, 10/07/2023	120.836	2,46
30.000.000	EUR	SG Issuer SA, 0.73%, 18/01/2023 ²	30.000	0,61
		Luxemburg - Gesamt	150.836	3,07
		Schweden (30. September 2021: 0,20 %)	-	-
		Schweiz (30. September 2021: 0,41 %)	-	-
		Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt	150.836	3,07
		Anlagen in Anleihen - Gesamt	150.836	3,07

Bestand	Währung	Kontrahent	Zins- sätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte³ (30. September 2021: 4,79 %)						
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 4,79 %)						
100.000.000	EUR	BNP Paribas SA	(0,35) %	03.10.2022	100.000	2,03
		Vereinigtes Königreich - Gesamt			100.000	2,03
		Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt			100.000	2,03

	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	4.796.970	97,67
Zahlungsmittel	125.046	2,55
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(10.830)	(0,22)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	4.911.186	100,00

Analyse des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	3,06
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	2,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)	92,27
Sonstige Vermögenswerte	2,64
Gesamtvermögen	100,00

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

²Nullkupon-Anleihe

³Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 102.062.000 EUR.

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2021: 28,09 %)				
Belgien (30. September 2021: 1,13 %)				
264.000.000	EUR	KBC Bank NV, 0.51%, 03/01/2023 ¹	263.657	0,74
		Belgien - Gesamt	263.657	0,74
Kanada (30. September 2021: 0,00 %)				
100.000.000	EUR	National Bank of Canada, 0.25%, 03/01/2023 ¹	99.936	0,28
684.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.96%, 14/07/2023	684.000	1,93
449.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.96%, 21/07/2023	449.000	1,26
		Kanada - Gesamt	1.232.936	3,47
Finnland (30. September 2021: 3,50 %)				
624.000.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.13%, 24/10/2022 ¹	623.953	1,76
175.000.000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.27%, 03/01/2023 ¹	174.879	0,49
200.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.26%, 03/01/2023 ¹	199.867	0,56
17.500.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 1.59%, 09/03/2023 ¹	17.380	0,05
		Finnland - Gesamt	1.016.079	2,86
Frankreich (30. September 2021: 2,18 %)				
124.500.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.33%, 01/11/2022 ¹	124.467	0,35
300.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.32%, 07/11/2022 ¹	299.907	0,84
210.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.34%, 08/11/2022 ¹	209.928	0,59
275.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 1.01%, 01/12/2022 ¹	274.546	0,77
263.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.99%, 02/12/2022 ¹	262.567	0,74
		Frankreich - Gesamt	1.171.415	3,29
Japan (30. September 2021: 13,36 %)				
99.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.47%, 05/10/2022 ¹	98.997	0,28
100.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., (0.07)%, 10/10/2022 ¹	100.001	0,28
14.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.33%, 26/10/2022 ¹	13.997	0,04
75.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.33%, 01/11/2022 ¹	74.980	0,21
90.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.38%, 10/11/2022 ¹	89.964	0,25
8.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 1.14%, 06/01/2023 ¹	7.976	0,02
250.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.75%, 19/10/2022 ¹	249.917	0,70
90.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.21%, 03/11/2022 ¹	89.984	0,25
183.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.38%, 18/11/2022 ¹	182.911	0,52
90.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.50%, 03/01/2023 ¹	89.885	0,25
86.500.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.28%, 03/01/2023 ¹	86.438	0,24
81.000.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.27%, 03/01/2023 ¹	80.944	0,23
43.500.000	EUR	Mizuho Bank Ltd., 0.28%, 03/01/2023 ¹	43.469	0,12
249.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 0.33%, 01/11/2022 ¹	248.934	0,70
149.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 0.33%, 01/11/2022 ¹	148.961	0,42
485.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 0.31%, 03/11/2022 ¹	484.871	1,36
96.000.000	EUR	Norinchukin Bank (The), 0.27%, 05/10/2022 ¹	95.999	0,27
300.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.77%, 18/10/2022 ¹	299.905	0,84
400.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.76%, 19/10/2022 ¹	399.865	1,13
233.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.63%, 21/10/2022 ¹	232.927	0,66
299.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.30%, 04/11/2022 ¹	298.920	0,84
130.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.63%, 19/10/2022 ¹	129.964	0,37
50.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.64%, 21/10/2022 ¹	49.984	0,14
110.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.76%, 02/11/2022 ¹	109.930	0,31
50.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.32%, 03/11/2022 ¹	49.986	0,14
80.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.31%, 04/11/2022 ¹	79.978	0,23
99.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.31%, 07/11/2022 ¹	98.971	0,28
54.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.38%, 18/11/2022 ¹	53.974	0,15
91.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 1.00%, 05/12/2022 ¹	90.841	0,26
		Japan - Gesamt	4.083.473	11,49

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Schweiz (30. September 2021: 6,93 %)			-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 0,99 %)				
478.000.000	EUR	Barclays Bank plc, 0.77%, 09/02/2023 ¹	476.686	1,34
40.000.000	EUR	Mizuho International plc, 0.64%, 21/10/2022 ¹	39.987	0,11
54.000.000	EUR	Mizuho International plc, 0.32%, 07/11/2022 ¹	53.983	0,15
75.000.000	EUR	Mizuho International plc, 0.40%, 14/11/2022 ¹	74.965	0,21
50.000.000	EUR	Mizuho International plc, 0.28%, 03/01/2023 ¹	49.964	0,14
35.000.000	EUR	Mizuho International plc, 0.50%, 03/01/2023 ¹	34.955	0,10
51.500.000	EUR	Mizuho International plc, 1.52%, 03/03/2023 ¹	51.174	0,15
65.000.000	EUR	Mizuho International plc, 1.74%, 10/03/2023 ¹	64.508	0,18
70.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, (0.47)%, 26/10/2022 ¹	70.021	0,20
767.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 0.74%, 01/02/2023 ¹	765.100	2,15
578.500.000	EUR	Standard Chartered Bank, 1.04%, 04/08/2023	578.500	1,63
Vereinigtes Königreich - Gesamt			2.259.843	6,36
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			10.027.403	28,21
Commercial Papers (30. September 2021: 41,94 %)				
Australien (30. September 2021: 0,00 %)				
297.000.000	EUR	Toyota Finance Australia Ltd., 0.28%, 03/01/2023 ¹	296.785	0,83
Australien - Gesamt			296.785	0,83
Österreich (30. September 2021: 0,93 %)				
194.000.000	EUR	Oesterreichische Kontrollbank AG, 0.84%, 15/11/2022 ¹	193.805	0,54
Österreich - Gesamt			193.805	0,54
Belgien (30. September 2021: 0,28 %)				
500.000.000	EUR	Kingdom of Belgium, 0.35%, 11/10/2022 ¹	499.961	1,41
Belgien - Gesamt			499.961	1,41
Dänemark (30. September 2021: 1,41 %)				
500.000.000	EUR	Jyske Bank A/S, 0.65%, 24/10/2022 ¹	499.811	1,41
Dänemark - Gesamt			499.811	1,41
Finnland (30. September 2021: 1,27 %)				
150.000.000	EUR	Kuntarahoitus OYJ, 0.62%, 14/10/2022 ¹	149.971	0,42
200.000.000	EUR	Kuntarahoitus OYJ, 0.62%, 04/11/2022 ¹	199.890	0,56
4.500.000	EUR	Nordea Bank Abp, (0.55)%, 04/10/2022 ¹	4.500	0,01
4.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 1.23%, 06/01/2023 ¹	3.987	0,01
27.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, 1.59%, 06/03/2023 ¹	26.818	0,08
Finnland - Gesamt			385.166	1,08
Frankreich (30. September 2021: 16,76 %)				
400.000.000	EUR	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.55%, 06/10/2022 ¹	399.982	1,12
600.000.000	EUR	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.65%, 09/01/2023	600.004	1,69
696.000.000	EUR	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.65%, 20/01/2023	696.005	1,96
22.000.000	EUR	Antalis SA, 0.38%, 03/10/2022 ¹	22.000	0,06
65.000.000	EUR	Antalis SA, 0.47%, 05/10/2022 ¹	64.998	0,18
20.000.000	EUR	Antalis SA, 0.68%, 12/10/2022 ¹	19.997	0,06
10.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 17/10/2022 ¹	9.997	0,03
169.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 19/10/2022 ¹	168.943	0,48
100.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 19/10/2022 ¹	99.966	0,28
40.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 26/10/2022 ¹	39.981	0,11
20.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 27/10/2022 ¹	19.990	0,06

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
22.000.000	EUR	Antalis SA, 0.00%, 28/10/2022 ¹	21.988	0,06
130.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 31/10/2022 ¹	129.923	0,37
25.000.000	EUR	Antalis SA, 0.76%, 31/10/2022 ¹	24.985	0,07
320.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, (0.01)%, 07/10/2022 ¹	320.000	0,90
339.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.42%, 05/12/2022 ¹	338.754	0,95
190.000.000	EUR	BPCE SA, 0.34%, 09/11/2022 ¹	189.934	0,53
916.000.000	EUR	BPCE SA, 0.83%, 03/01/2023	916.000	2,58
185.000.000	EUR	CA Consumer Finance SA, 0.72%, 03/10/2022 ¹	185.000	0,52
227.000.000	EUR	CA Consumer Finance SA, 0.72%, 04/10/2022 ¹	226.995	0,64
165.000.000	EUR	CA Consumer Finance SA, 0.72%, 05/10/2022 ¹	164.993	0,46
155.000.000	EUR	CA Consumer Finance SA, 0.73%, 10/10/2022 ¹	154.978	0,44
200.000.000	EUR	Dexia Credit Local SA, 0.44%, 05/01/2023 ¹	199.771	0,56
300.000.000	EUR	Dexia Credit Local SA, 0.49%, 11/01/2023 ¹	299.593	0,84
100.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 0.63%, 03/10/2022 ¹	100.000	0,28
100.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 0.63%, 04/10/2022 ¹	99.998	0,28
1.000.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 0.63%, 06/10/2022 ¹	999.948	2,81
50.000.000	EUR	Satellite, 0.75%, 21/10/2022 ¹	49.981	0,14
91.000.000	EUR	Satellite, 0.75%, 26/10/2022 ¹	90.956	0,26
10.000.000	EUR	Satellite, 0.44%, 31/10/2022 ¹	9.997	0,03
172.000.000	EUR	Societe Generale SA, 0.81%, 03/01/2023	172.000	0,48
		Frankreich - Gesamt	6.837.657	19,23
		Deutschland (30. September 2021: 1,65 %)		
419.000.000	EUR	DZ Bank AG, 0.65%, 02/02/2023 ¹	418.080	1,18
		Deutschland - Gesamt	418.080	1,18
		Irland (30. September 2021: 2,61 %)		
6.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.47%, 05/10/2022 ¹	6.000	0,02
182.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.62%, 10/10/2022 ¹	181.978	0,51
160.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 19/10/2022 ¹	159.947	0,45
80.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 19/10/2022 ¹	79.973	0,23
53.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 24/10/2022 ¹	52.977	0,15
29.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 24/10/2022 ¹	28.987	0,08
165.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 25/10/2022 ¹	164.924	0,46
46.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 26/10/2022 ¹	45.978	0,13
165.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 27/10/2022 ¹	164.918	0,46
155.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 27/10/2022 ¹	154.923	0,44
39.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 31/10/2022 ¹	38.977	0,11
30.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.75%, 31/10/2022 ¹	29.983	0,09
90.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.90%, 15/11/2022 ¹	89.903	0,25
65.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 0.92%, 16/11/2022 ¹	64.927	0,18
30.000.000	EUR	Matchpoint Finance plc, 1.22%, 06/01/2023 ¹	29.904	0,08
		Irland - Gesamt	1.294.299	3,64
		Japan (30. September 2021: 0,57 %)		
498.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.76%, 14/10/2022 ¹	497.884	1,40
		Japan - Gesamt	497.884	1,40
		Luxemburg (30. September 2021: 1,91 %)		
90.000.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 0.80%, 17/10/2022 ¹	89.972	0,25
97.595.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 0.80%, 18/10/2022 ¹	97.563	0,27
133.128.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 0.80%, 24/10/2022 ¹	133.066	0,37
23.477.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 0.77%, 24/10/2022 ¹	23.466	0,07
50.719.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 0.80%, 25/10/2022 ¹	50.694	0,14
52.641.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 0.88%, 16/11/2022 ¹	52.585	0,15
21.058.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 0.50%, 21/11/2022 ¹	21.044	0,06
20.000.000	EUR	Albion Capital Corp. SA, 1.00%, 22/11/2022 ¹	19.972	0,06

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Luxemburg (Fortsetzung)				
20.000.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 0.81%, 14/10/2022 ¹	19.995	0,06
112.000.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 0.81%, 17/10/2022 ¹	111.965	0,32
50.000.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 0.75%, 26/10/2022 ¹	49.976	0,14
100.000.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 0.44%, 31/10/2022 ¹	99.966	0,28
25.000.000	EUR	Sunderland Receivables SA, 0.94%, 16/11/2022 ¹	24.971	0,07
Luxemburg - Gesamt			795.235	2,24
Niederlande (30. September 2021: 2,27 %)				
1.265.000.000	EUR	Kingdom of The Netherlands, 0.53%, 03/10/2022 ¹	1.265.000	3,56
15.000.000	EUR	PACCAR Financial Europe BV, 0.74%, 27/10/2022 ¹	14.993	0,04
Niederlande - Gesamt			1.279.993	3,60
Norwegen (30. September 2021: 0,77 %)				
			-	-
Schweden (30. September 2021: 8,36 %)				
648.000.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.49%, 03/01/2023 ¹	647.186	1,82
75.000.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.49%, 03/01/2023 ¹	74.906	0,21
44.000.000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.52%, 03/01/2023 ¹	43.942	0,12
Schweden - Gesamt			766.034	2,15
Schweiz (30. September 2021: 0,06 %)				
			-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 1,76 %)				
174.000.000	EUR	Barclays Bank plc, (0.07)%, 12/10/2022 ¹	174.003	0,49
428.500.000	EUR	Barclays Bank plc, 0.29%, 04/11/2022 ¹	428.390	1,21
43.000.000	EUR	NTT Finance UK Ltd., 0.90%, 11/10/2022 ¹	42.991	0,12
155.000.000	EUR	NTT Finance UK Ltd., 0.83%, 17/10/2022 ¹	154.950	0,44
90.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, (0.47)%, 12/10/2022 ¹	90.011	0,25
50.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 1.40%, 23/01/2023 ¹	49.783	0,14
39.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 1.55%, 14/02/2023 ¹	38.777	0,11
44.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 0.90%, 20/02/2023 ¹	43.847	0,12
15.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 1.47%, 06/03/2023 ¹	14.906	0,04
Vereinigtes Königreich - Gesamt			1.037.658	2,92
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 1,33 %)				
49.994.000	EUR	Mont Blanc Capital Corp., (0.06)%, 13/10/2022 ¹	49.995	0,14
57.593.000	EUR	Mont Blanc Capital Corp., 1.07%, 12/12/2022 ¹	57.473	0,16
5.000.000	EUR	Sheffield Receivables Co. LLC, 0.75%, 26/10/2022 ¹	4.998	0,02
Vereinigte Staaten - Gesamt			112.466	0,32
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			14.914.834	41,95
Termineinlagen (30. September 2021: 11,72 %)				
Österreich (30. September 2021: 0,00 %)				
1.720.043.725	EUR	Erste Group Bank AG, 0.68%, 03/10/2022	1.720.044	4,84
Österreich - Gesamt			1.720.044	4,84
Belgien (30. September 2021: 0,00 %)				
35.800.000	EUR	KBC Bank NV, 0.68%, 03/10/2022	35.800	0,10
Belgien - Gesamt			35.800	0,10
Frankreich (30. September 2021: 5,10 %)				
300.000.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.60%, 03/10/2022	300.000	0,84

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (Fortsetzung)				
199.854.605	EUR	Frankreich (Fortsetzung) BRED Banque Populaire, 0.63%, 03/10/2022	199.855	0,56
		Frankreich - Gesamt	499.855	1,40
1.600.408.934	EUR	Deutschland (30. September 2021: 0,00 %) DZ Bank AG, 0.60%, 03/10/2022	1.600.409	4,50
		Deutschland - Gesamt	1.600.409	4,50
50.009.306	EUR	Japan (30. September 2021: 1,26 %) Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.67%, 03/10/2022	50.009	0,14
200.003.611	EUR	MUFG Bank Ltd., 0.65%, 03/10/2022	200.003	0,56
250.065.632	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.60%, 03/10/2022	250.066	0,71
		Japan - Gesamt	500.078	1,41
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 5,36 %)	-	-
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			4.356.186	12,25
Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2021: 0,22 %)				
		Österreich (30. September 2021: 0,22 %)	-	-
1.000.000	EUR	Frankreich (30. September 2021: 0,00 %) France Treasury Bill BTF, 0.26%, 05/10/2022 ¹	1.000	0,01
1.000.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.18%, 12/10/2022 ¹	1.000	-
		Frankreich - Gesamt	2.000	0,01
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			2.000	0,01
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 3,94 %)				
		Frankreich (30. September 2021: 0,15 %)	-	-
600.000.000	EUR	Luxemburg (30. September 2021: 3,75 %) Purple Protected Asset, FRN, 0.69%, 10/07/2023	600.000	1,69
430.000.000	EUR	SG Issuer SA, 0.73%, 18/01/2023 ²	430.000	1,21
		Luxemburg - Gesamt	1.030.000	2,90
		Schweiz (30. September 2021: 0,04 %)	-	-
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			1.030.000	2,90
Supranationale Wertpapiere (30. September 2021: 4,10 %)				
583.000.000	EUR	European Union Bill, 0.00%, 06/01/2023 ²	582.894	1,64

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Supranationale Wertpapiere (Fortsetzung)				
375.000.000	EUR	European Union Bill, 0.00%, 03/02/2023 ²	374.718	1,05
Anlagen in supranationalen Wertpapieren - Gesamt			957.612	2,69
Anlagen in Anleihen - Gesamt			1.989.612	5,60

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte³ (30. September 2021: 10,55 %)						
Kanada (30. September 2021: 2,51 %)						
794.500.000	EUR	Bank of Nova Scotia plc	(0,25) %	03.10.2022	794.500	2,23
Kanada - Gesamt					794.500	2,23
Frankreich (30. September 2021: 1,69 %)						
800.000.000	EUR	Natixis SA	(0,30) %	03.10.2022	800.000	2,25
Frankreich - Gesamt					800.000	2,25
Niederlande (30. September 2021: 1,69 %)						
750.000.000	EUR	ING Bank NV	(0,28) %	03.10.2022	750.000	2,11
Niederlande - Gesamt					750.000	2,11
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 4,66 %)						
100.000.000	EUR	BNP Paribas SA	(0,35) %	03.10.2022	100.000	0,28
300.000.000	EUR	MUFG Securities EMEA plc	(0,28) %	03.10.2022	300.000	0,84
Vereinigtes Königreich - Gesamt					400.000	1,12
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,00 %)						
800.000.000	EUR	BofA Securities Europe SA	(0,33) %	03.10.2022	800.000	2,25
Vereinigte Staaten - Gesamt					800.000	2,25
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					3.544.500	9,96

	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	34.832.535	97,97
Barmittel und Barsicherheiten	979.720	2,76
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(259.608)	(0,73)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	35.552.647	100,00

BLACKROCK ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Analyse des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)
Sonstige Vermögenswerte

**% des Gesamt-
vermögens**

5,55

9,89

81,75

2,81

Gesamtvermögen

100,00

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

²Nullkupon-Anleihe

³Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 3.606.019.000 EUR.

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (30. September 2021: 24,74 %)				
		Belgien (30. September 2021: 3,12 %)	-	-
		Kanada (30. September 2021: 0,00 %)		
100.000.000	EUR	Toronto-Dominion Bank (The), 0.96%, 21/07/2023	99.303	1,92
		Kanada - Gesamt	99.303	1,92
		Finnland (30. September 2021: 3,92 %)	-	-
		Frankreich (30. September 2021: 0,00 %)		
188.000.000	EUR	Credit Agricole SA, 0.32%, 08/11/2022 ¹	187.832	3,63
		Frankreich - Gesamt	187.832	3,63
		Irland (30. September 2021: 0,00 %)		
10.000.000	EUR	Hewlett-packard International Bank DAC, 0.02%, 03/10/2022 ¹	9.999	0,19
		Irland - Gesamt	9.999	0,19
		Japan (30. September 2021: 5,49 %)		
31.000.000	EUR	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 0.32%, 26/10/2022 ¹	30.985	0,60
100.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 0.32%, 01/11/2022 ¹	99.934	1,93
88.000.000	EUR	MUFG Bank Ltd., 0.32%, 01/11/2022 ¹	87.948	1,70
15.000.000	EUR	Norinchukin Bank (The), 0.69%, 17/10/2022 ¹	14.995	0,29
45.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0.58%, 21/10/2022 ¹	44.981	0,87
		Japan - Gesamt	278.843	5,39
		Schweiz (30. September 2021: 4,69 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 7,52 %)		
100.000.000	EUR	Standard Chartered Bank, 0.72%, 01/02/2023 ¹	99.487	1,92
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	99.487	1,92
		Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt	675.464	13,05
Commercial Papers (30. September 2021: 43,61 %)				
		Kanada (30. September 2021: 1,86 %)		
29.225.000	CAD	Enbridge Gas, Inc., 2.90%, 03/10/2022 ¹	21.709	0,42
129.000.000	CAD	Enbridge Gas, Inc., 3.06%, 07/10/2022 ¹	95.800	1,85
		Kanada - Gesamt	117.509	2,27
		Dänemark (30. September 2021: 3,13 %)	-	-
		Frankreich (30. September 2021: 16,11 %)		
96.000.000	EUR	Antalis SA, 0.67%, 19/10/2022 ¹	95.956	1,85
151.000.000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 07/10/2022 ¹	150.979	2,92
80.000.000	USD	Engie SA, 3.16%, 25/10/2022 ¹	81.466	1,57
200.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 0.47%, 03/10/2022 ¹	199.990	3,86
200.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 0.50%, 04/10/2022 ¹	199.996	3,87
197.000.000	EUR	La Banque Postale SA, 1.01%, 16/12/2022 ¹	196.618	3,80
61.400.000	EUR	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.53%, 03/10/2022 ¹	61.397	1,19
30.000.000	EUR	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.53%, 04/10/2022 ¹	30.000	0,58
		Frankreich - Gesamt	1.016.402	19,64

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
100.000.000	EUR	Deutschland (30. September 2021: 1,83 %) DZ Bank AG, 0.64%, 02/02/2023 ¹	99.530	1,92
		Deutschland - Gesamt	99.530	1,92
50.000.000	EUR	Irland (30. September 2021: 0,39 %) Matchpoint Finance plc, 0.66%, 26/10/2022 ¹	49.969	0,97
		Irland - Gesamt	49.969	0,97
50.000.000	EUR	Japan (30. September 2021: 1,06 %) Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.61%, 27/10/2022 ¹	49.973	0,97
200.000.000	EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.87%, 16/11/2022 ¹	199.759	3,86
		Japan - Gesamt	249.732	4,83
60.000.000	EUR	Luxemburg (30. September 2021: 0,00 %) DH Europe Finance II SARL, 0.82%, 03/11/2022 ¹	59.956	1,16
50.000.000	EUR	DH Europe Finance II SARL, 1.07%, 14/11/2022 ¹	49.944	0,96
		Luxemburg - Gesamt	109.900	2,12
90.000.000	EUR	Niederlande (30. September 2021: 0,56 %) BMW Finance NV, 0.26%, 13/10/2022 ¹	89.976	1,74
50.000.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.93%, 17/10/2022 ¹	49.983	0,97
50.000.000	EUR	Enel Finance International NV, 0.94%, 02/11/2022 ¹	49.956	0,97
200.000.000	EUR	Kingdom of The Netherlands, 0.44%, 03/10/2022 ¹	199.989	3,86
82.000.000	EUR	Universal Music Group NV, 0.65%, 06/10/2022 ¹	81.995	1,58
8.000.000	EUR	Universal Music Group NV, 0.91%, 28/10/2022 ¹	7.994	0,15
		Niederlande - Gesamt	479.893	9,27
143.000.000	EUR	Spanien (30. September 2021: 2,50 %) Santander Consumer Finance SA, 0.60%, 27/10/2022 ¹	142.923	2,76
		Spanien - Gesamt	142.923	2,76
100.000.000	EUR	Schweden (30. September 2021: 0,00 %) Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.39%, 03/10/2022 ¹	99.995	1,93
		Schweden - Gesamt	99.995	1,93
170.000.000	EUR	Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 11,56 %) Barclays Bank plc, 0.96%, 05/05/2023	170.050	3,29
50.000.000	EUR	Brambles Finance plc, 0.91%, 25/10/2022 ¹	49.962	0,97
25.000.000	EUR	Brambles Finance plc, 0.48%, 01/11/2022 ¹	24.975	0,48
74.000.000	EUR	National Grid plc, 0.94%, 24/10/2022 ¹	73.964	1,43
74.000.000	EUR	National Grid plc, 0.95%, 28/10/2022 ¹	73.959	1,43
58.000.000	EUR	NTT Finance UK Ltd., 0.81%, 11/10/2022 ¹	57.983	1,12
60.000.000	EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 0.90%, 02/02/2023 ¹	59.689	1,15
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	510.582	9,87
30.000.000	EUR	Vereinigte Staaten (30. September 2021: 4,61 %) Avery Dennison Corp., 0.67%, 03/10/2022 ¹	29.998	0,58
2.000.000	EUR	Avery Dennison Corp., 0.73%, 07/10/2022 ¹	2.000	0,04
30.000.000	EUR	Avery Dennison Corp., 0.75%, 03/11/2022 ¹	29.978	0,58
15.000.000	EUR	Avery Dennison Corp., 0.83%, 03/11/2022 ¹	14.988	0,29
25.000.000	EUR	Danaher Corp., 0.82%, 02/11/2022 ¹	24.983	0,48
25.000.000	EUR	Danaher Corp., 1.07%, 15/11/2022 ¹	24.971	0,48
52.000.000	EUR	Danaher Corp., 1.07%, 16/11/2022 ¹	51.937	1,01
125.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 3.60%, 26/10/2022 ¹	127.280	2,46
100.000.000	EUR	Fidelity National Information Services, Inc., 0.77%, 03/11/2022 ¹	99.925	1,93

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
96.000.000	EUR	Fisvec, 0.88%, 03/11/2022 ¹	95.913	1,85
24.000.000	EUR	Fisvec, 0.98%, 17/11/2022 ¹	23.965	0,46
73.000.000	EUR	Hewlett Packard Enterprise Co., 0.85%, 24/10/2022 ¹	72.965	1,41
50.000.000	EUR	Hewlett Packard Enterprise Co., 0.85%, 24/10/2022 ¹	49.976	0,97
42.000.000	EUR	Realty Income Corp., 0.88%, 14/10/2022 ¹	41.982	0,81
82.000.000	EUR	Realty Income Corp., 0.90%, 19/10/2022 ¹	81.953	1,58
26.000.000	EUR	Realty Income Corp., 0.92%, 09/11/2022 ¹	25.966	0,50
Vereinigte Staaten - Gesamt			798.780	15,43
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			3.675.215	71,01
Termineinlagen (30. September 2021: 6,39 %)				
Frankreich (30. September 2021: 1,72 %)				
42.900.000	EUR	BNP Paribas SA, 0.60%, 03/10/2022	42.900	0,83
Frankreich - Gesamt			42.900	0,83
Deutschland (30. September 2021: 0,00 %)				
200.053.895	EUR	DZ Bank AG, 0.60%, 03/10/2022	200.054	3,86
Deutschland - Gesamt			200.054	3,86
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 4,67 %)				
			-	-
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			242.954	4,69
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2021: 0,00 %)				
Frankreich (30. September 2021: 0,00 %)				
50.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.19%, 05/10/2022 ¹	50	0,01
50.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.20%, 12/10/2022 ¹	50	-
50.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.25%, 19/10/2022 ¹	50	-
50.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.28%, 26/10/2022 ¹	50	-
50.000	EUR	France Treasury Bill BTF, 0.24%, 02/11/2022 ¹	50	-
Frankreich - Gesamt			250	0,01
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			250	0,01
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 26,50 %)				
Australien (30. September 2021: 1,69 %)				
211.000.000	EUR	Macquarie Bank Ltd., FRN, 0.95%, 20/10/2023	212.027	4,10
Australien - Gesamt			212.027	4,10
Finnland (30. September 2021: 2,36 %)				
87.000.000	EUR	OP Corporate Bank plc, FRN, 1.34%, 17/05/2024	87.845	1,70
Finnland - Gesamt			87.845	1,70

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
162.000.000	EUR	Frankreich (30. September 2021: 1,23 %) HSBC Continental Europe SA, FRN, 2.17%, 28/06/2024	163.453	3,16
		Frankreich - Gesamt	163.453	3,16
		Deutschland (30. September 2021: 2,36 %)	-	-
		Japan (30. September 2021: 0,48 %)	-	-
180.000.000	EUR	Luxemburg (30. September 2021: 2,81 %) Purple Protected Asset, FRN, 0.69%, 10/07/2023	181.280	3,50
		Luxemburg - Gesamt	181.280	3,50
100.000.000	EUR	Niederlande (30. September 2021: 8,51 %) Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 0.82%, 19/01/2023	100.109	1,93
100.000.000	EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 0.96%, 28/04/2023	100.219	1,94
		Niederlande - Gesamt	200.328	3,87
		Neuseeland (30. September 2021: 0,50 %)	-	-
162.900.000	EUR	Schweiz (30. September 2021: 2,58 %) Credit Suisse AG, FRN, 1.62%, 01/09/2023	163.017	3,15
28.915.000	EUR	Credit Suisse AG, FRN, 1.81%, 31/05/2024	29.001	0,56
		Schweiz - Gesamt	192.018	3,71
		Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 2,85 %)	-	-
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 1,13 %)	-	-
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			1.036.951	20,04
Anlagen in Anleihen - Gesamt			1.037.201	20,05

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte²				
Buy EUR 22,183,136; Sell CAD 29,150,182	Toronto-Dominion Bank	03.10.2022	528	0,01
Buy EUR 56,937; Sell CAD 74,818	RBC	03.10.2022	1	-
Buy EUR 98,140,508; Sell CAD 128,625,840	Toronto-Dominion Bank	07.10.2022	2.605	0,05
Buy EUR 285,465; Sell CAD 374,160	Standard Chartered	07.10.2022	8	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2021: 0,01 %)			3.142	0,06
Devisenterminkontrakte²				
Buy EUR 594,542; Sell USD 606,223	RBC	25.10.2022	(23)	-
Buy EUR 77,866,847; Sell USD 79,393,777	Barclays	25.10.2022	(3.057)	(0,06)
Buy EUR 1,051,824; Sell USD 1,075,000	Toronto-Dominion Bank	26.10.2022	(44)	-
Buy EUR 121,256,769; Sell USD 123,925,000	HSBC	26.10.2022	(5.047)	(0,10)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2021: (0,06) %)			(8.171)	(0,16)

BLACKROCK ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

	Zeitwert Tsd. EUR	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	5.633.976	108,86
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	(8.171)	(0,16)
Barmittel und Barsicherheiten	189.169	3,65
Zahlungsmitteläquivalente		
Bestand Währung Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (30. September 2021: 1,95 %)		
12.053 EUR BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0) ³	1.184	0,02
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt	<u>1.184</u>	<u>0,02</u>
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	<u>(640.337)</u>	<u>(12,37)</u>
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	<u>5.175.821</u>	<u>100,00</u>
		% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens		
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind		17,77
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)		78,71
Investmentfonds (CIS)		0,02
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,05
Sonstige Vermögenswerte		<u>3,45</u>
Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

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.

³Dem Fonds nahestehende Partei.

	Basisengagement TSD. EUR
Derivative Finanzinstrumente	
Devisenterminkontrakte	326.803

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventar- werts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2021: 46,26 %)				
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 46,26 %)				
28.500.000	GBP	UK Treasury Bill, 1.70%, 03/10/2022 ¹	28.500	1,03
202.453.000	GBP	UK Treasury Bill, 1.72%, 10/10/2022 ¹	202.387	7,29
25.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 1.40%, 31/10/2022 ¹	24.973	0,90
25.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 1.97%, 07/11/2022 ¹	24.953	0,90
75.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 2.01%, 14/11/2022 ¹	74.828	2,69
60.000.000	GBP	UK Treasury Bill, 2.66%, 12/12/2022 ¹	59.696	2,15
17.700.000	GBP	UK Treasury Bill, 2.37%, 03/01/2023 ¹	17.595	0,63
800.000	GBP	UK Treasury Bill, 2.37%, 09/01/2023 ¹	795	0,03
500.000	GBP	UK Treasury Bill, 2.59%, 23/01/2023 ¹	496	0,02
1.300.000	GBP	UK Treasury Bill, 2.60%, 30/01/2023 ¹	1.289	0,04
500.000	GBP	UK Treasury Bill, 2.69%, 06/02/2023 ¹	495	0,02
Vereinigtes Königreich - Gesamt			436.007	15,70
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			436.007	15,70
Anlagen in Anleihen - Gesamt			436.007	15,70

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventar- werts
Umgekehrte Repogeschäfte² (30. September 2021: 56,60 %)						
Australien (30. September 2021: 8,28 %)						
					-	-
Frankreich (30. September 2021: 2,07 %)						
					-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 46,25 %)						
251.279.770	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	251.280	9,05
59.957.211	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,15 %	03.10.2022	59.957	2,16
23.965.251	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,15 %	03.10.2022	23.965	0,86
20.136.171	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,15 %	03.10.2022	20.136	0,73
99.728.782	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	04.10.2022	99.730	3,59
200.000.000	GBP	Barclays Bank plc	2,10 %	03.10.2022	200.000	7,20
157.000.000	GBP	BNP Paribas SA	2,05 %	03.10.2022	157.000	5,66
66.562.667	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,15 %	03.10.2022	66.563	2,40
52.709.089	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,15 %	03.10.2022	52.709	1,90
21.728.588	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,15 %	03.10.2022	21.729	0,78
21.050.743	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,15 %	03.10.2022	21.051	0,76
20.918.343	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,15 %	03.10.2022	20.918	0,75
18.871.068	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,15 %	03.10.2022	18.871	0,68
104.698.183	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,10 %	04.10.2022	104.698	3,77
		Credit Agricole Corporate and Investment Bank				
101.701.899	GBP	Bank	2,15 %	04.10.2022	101.702	3,66
51.314.040	GBP	Merrill Lynch International	1,97 %	03.10.2022	51.314	1,85
51.314.040	GBP	Merrill Lynch International	1,97 %	03.10.2022	51.314	1,85
50.840.979	GBP	Merrill Lynch International	1,97 %	03.10.2022	50.841	1,83
74.645.405	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,15 %	03.10.2022	74.645	2,69
67.340.225	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,15 %	03.10.2022	67.340	2,43
59.873.944	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,15 %	03.10.2022	59.874	2,16
99.340.952	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,10 %	04.10.2022	99.341	3,58
200.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd.	2,08 %	03.10.2022	200.000	7,20
152.751.460	GBP	Santander UK plc	2,10 %	03.10.2022	152.751	5,50
200.000.000	GBP	Societe Generale SA	2,05 %	03.10.2022	200.000	7,20

BLACKROCK ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (Fortsetzung)						
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)						
163.809.158	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	163.809	5,90
89.864.024	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	89.864	3,24
98.694.501	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	98.695	3,56
85.081.467	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	85.081	3,06
Vereinigtes Königreich - Gesamt					2.665.178	96,00
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					2.665.178	96,00
					Zeitwert	% des Netto-
					Tsd. GBP	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					3.101.185	111,70
Zahlungsmittel					80.623	2,90
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(405.364)	(14,60)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					2.776.444	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						Gesamt-
Sonstige Vermögenswerte						vermögens
Gesamtvermögen						97,45
						2,55
						100,00

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

²Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 2.714.171.000 GBP.

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2021: 39,08 %)				
Australien (30. September 2021: 2,02 %)				
25.000.000	GBP	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 2.35%, 03/01/2023 ¹	24.778	0,30
60.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 0.76%, 07/11/2022 ¹	59.845	0,74
56.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 2.00%, 06/02/2023	55.667	0,69
		Australien - Gesamt	140.290	1,73
Belgien (30. September 2021: 0,00 %)				
65.000.000	GBP	BNP Paribas Fortis SA, 2.90%, 20/12/2022	64.961	0,80
		Belgien - Gesamt	64.961	0,80
Kanada (30. September 2021: 6,64 %)				
100.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 0.80%, 21/10/2022	99.937	1,23
75.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 0.79%, 07/11/2022	74.900	0,93
70.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 2.00%, 21/02/2023 ¹	69.040	0,85
		Kanada - Gesamt	243.877	3,01
Finnland (30. September 2021: 1,31 %)				
27.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 0.70%, 28/10/2022 ¹	26.952	0,33
86.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 2.58%, 25/01/2023 ¹	85.028	1,05
40.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 2.58%, 06/02/2023 ¹	39.484	0,49
16.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 1.98%, 09/02/2023	15.899	0,20
		Finnland - Gesamt	167.363	2,07
Frankreich (30. September 2021: 1,31 %)				
30.000.000	GBP	BNP Paribas SA, 1.78%, 10/10/2022	29.996	0,37
20.000.000	GBP	BNP Paribas UK Holdings Ltd., 1.75%, 07/10/2022	19.998	0,25
60.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 1.75%, 10/10/2022 ¹	59.962	0,74
		Frankreich - Gesamt	109.956	1,36
Japan (30. September 2021: 6,96 %)				
80.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.72%, 03/10/2022 ¹	79.985	0,99
10.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.84%, 03/10/2022	10.000	0,12
20.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.75%, 04/10/2022 ¹	19.995	0,25
10.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.75%, 04/10/2022	9.999	0,12
15.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.75%, 05/10/2022	14.999	0,19
20.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.75%, 06/10/2022	19.998	0,25
50.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 2.53%, 08/11/2022	50.007	0,62
50.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 2.53%, 10/11/2022 ¹	49.863	0,62
20.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 2.05%, 27/10/2022 ¹	19.965	0,25
10.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 2.09%, 28/10/2022 ¹	9.982	0,12
10.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.10%, 07/10/2022	10.000	0,12
20.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.11%, 07/11/2022	19.992	0,25
110.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.19%, 09/11/2022	109.958	1,36
70.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.19%, 10/11/2022	69.971	0,86
70.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.19%, 14/11/2022	69.961	0,86
		Japan - Gesamt	564.675	6,98
Luxemburg (30. September 2021: 0,00 %)				
44.000.000	GBP	DNB Luxembourg SA, 2.52%, 08/02/2023	43.845	0,54
		Luxemburg - Gesamt	43.845	0,54
Niederlande (30. September 2021: 2,74 %)				
105.000.000	GBP	ING Bank NV, 2.55%, 06/02/2023 ¹	103.718	1,28
		Niederlande - Gesamt	103.718	1,28

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Norwegen (30. September 2021: 0,00 %)				
44.000.000	GBP	DNB Bank ASA, 2.53%, 08/02/2023	43.847	0,54
		Norwegen - Gesamt	43.847	0,54
Singapur (30. September 2021: 6,67 %)				
25.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 1.65%, 03/10/2022 ¹	24.996	0,31
95.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 1.80%, 14/10/2022 ¹	94.918	1,17
100.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 2.75%, 16/12/2022 ¹	99.359	1,23
20.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 2.71%, 16/12/2022	19.985	0,25
50.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 1.76%, 12/10/2022	49.992	0,62
15.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 1.95%, 21/10/2022	14.997	0,19
25.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.69%, 08/12/2022	24.989	0,31
10.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.68%, 13/12/2022	9.981	0,12
10.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.35%, 03/01/2023	9.975	0,12
10.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.50%, 03/02/2023	9.966	0,12
10.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.59%, 10/02/2023	9.966	0,12
80.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.61%, 16/02/2023	79.715	0,98
30.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.78%, 17/02/2023	29.911	0,37
		Singapur - Gesamt	478.750	5,91
Schweden (30. September 2021: 3,36 %)				
60.000.000	GBP	Handelsbanken plc, 1.73%, 10/10/2022	59.990	0,74
30.000.000	GBP	Handelsbanken plc, 1.75%, 11/10/2022	29.994	0,37
25.000.000	GBP	Handelsbanken plc, 1.90%, 06/01/2023	24.901	0,31
		Schweden - Gesamt	114.885	1,42
Schweiz (30. September 2021: 1,59 %)				
40.000.000	GBP	UBS AG, 0.77%, 04/11/2022	39.936	0,49
18.000.000	GBP	UBS AG, 2.31%, 13/01/2023	17.944	0,22
12.000.000	GBP	UBS AG, 2.32%, 13/01/2023	11.963	0,15
50.000.000	GBP	UBS AG, 2.00%, 24/02/2023	49.704	0,62
32.000.000	GBP	UBS, Inc., 2.00%, 23/02/2023	31.808	0,39
		Schweiz - Gesamt	151.355	1,87
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 4,56 %)				
67.000.000	GBP	Standard Chartered Bank, 2.00%, 07/11/2022	66.950	0,83
58.000.000	GBP	Standard Chartered Bank, 2.17%, 05/12/2022	57.920	0,71
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	124.870	1,54
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 1,92 %)				
20.000.000	GBP	Bank of America NA, 2.45%, 03/02/2023 ¹	19.739	0,25
		Vereinigte Staaten - Gesamt	19.739	0,25
Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt			2.372.131	29,30
Commercial Papers (30. September 2021: 28,14 %)				
Finnland (30. September 2021: 3,31 %)				
27.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 0.69%, 27/10/2022 ¹	26.954	0,33
50.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 1.97%, 06/02/2023 ¹	49.356	0,61
30.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 1.97%, 06/02/2023 ¹	29.613	0,37
40.000.000	GBP	OP Corporate Bank plc, 2.36%, 09/01/2023 ¹	39.631	0,49
		Finnland - Gesamt	145.554	1,80

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Frankreich (30. September 2021: 6,05 %)				
85.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.42%, 16/01/2023 ¹	84.039	1,04
90.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.40%, 09/03/2023 ¹	88.319	1,09
25.000.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 2.17%, 06/10/2022 ¹	24.990	0,31
23.000.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 2.37%, 20/10/2022 ¹	22.968	0,28
		Frankreich - Gesamt	220.316	2,72
Deutschland (30. September 2021: 1,11 %)				
75.000.000	GBP	Allianz SE, 1.73%, 25/10/2022 ¹	74.872	0,92
55.000.000	GBP	Allianz SE, 1.73%, 26/10/2022 ¹	54.902	0,68
65.000.000	GBP	Allianz SE, 1.73%, 27/10/2022 ¹	64.880	0,80
92.000.000	GBP	DZ Bank AG, 2.28%, 13/01/2023 ¹	91.119	1,12
43.000.000	GBP	DZ Bank AG, 2.42%, 17/01/2023 ¹	42.570	0,53
44.000.000	GBP	DZ Bank AG, 2.51%, 01/02/2023 ¹	43.488	0,54
		Deutschland - Gesamt	371.831	4,59
Irland (30. September 2021: 3,30 %)				
7.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 2.27%, 12/10/2022 ¹	6.994	0,09
100.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 2.30%, 17/10/2022 ¹	99.884	1,23
25.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 2.27%, 17/10/2022 ¹	24.971	0,31
65.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 2.37%, 20/10/2022 ¹	64.911	0,80
		Irland - Gesamt	196.760	2,43
Luxemburg (30. September 2021: 0,52 %)				
20.000.000	GBP	Sunderland Receivables SA, 2.25%, 12/10/2022 ¹	19.985	0,25
18.000.000	GBP	Sunderland Receivables SA, 2.37%, 20/10/2022 ¹	17.977	0,22
		Luxemburg - Gesamt	37.962	0,47
Niederlande (30. September 2021: 7,29 %)				
180.000.000	GBP	Kingdom of The Netherlands, 2.25%, 03/10/2022 ¹	179.962	2,22
		Niederlande - Gesamt	179.962	2,22
Singapur (30. September 2021: 1,41 %)				
			-	-
Schweden (30. September 2021: 2,74 %)				
			-	-
Schweiz (30. September 2021: 1,51 %)				
24.000.000	GBP	UBS AG, 1.97%, 24/02/2023 ¹	23.666	0,29
		Schweiz - Gesamt	23.666	0,29
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 0,00 %)				
200.000.000	GBP	Barclays Bank UK plc, 2.16%, 03/10/2022 ¹	199.961	2,47
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	199.961	2,47
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,90 %)				
11.000.000	GBP	Mont Blanc Capital Corp., 2.32%, 18/10/2022 ¹	10.987	0,14
		Vereinigte Staaten - Gesamt	10.987	0,14
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			1.386.999	17,13

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (30. September 2021: 22,55 %)				
200.582.336	GBP	Österreich (30. September 2021: 0,00 %) Erste Group Bank AG, 2.17%, 03/10/2022	200.582	2,48
		Österreich - Gesamt	200.582	2,48
49.800.000	GBP	Belgien (30. September 2021: 2,00 %) KBC Bank NV, 2.17%, 03/10/2022	49.800	0,61
		Belgien - Gesamt	49.800	0,61
300.000.000	GBP	Kanada (30. September 2021: 1,01 %) Bank of Nova Scotia (The), 2.19%, 03/10/2022	300.000	3,71
		Kanada - Gesamt	300.000	3,71
201.418.603	GBP	Frankreich (30. September 2021: 3,03 %) BRED Banque Populaire, 2.19%, 03/10/2022	201.419	2,49
400.000.000	GBP	Credit Mutuel, 2.10%, 03/10/2022	400.000	4,94
		Frankreich - Gesamt	601.419	7,43
450.000.000	GBP	Deutschland (30. September 2021: 0,00 %) DZ Bank AG, 2.16%, 03/10/2022	450.000	5,56
		Deutschland - Gesamt	450.000	5,56
350.000.000	GBP	Japan (30. September 2021: 4,03 %) Mizuho Bank Ltd., 2.18%, 03/10/2022	350.000	4,32
300.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 2.20%, 03/10/2022	300.000	3,71
		Japan - Gesamt	650.000	8,03
100.000.000	GBP	Spanien (30. September 2021: 4,54 %) Banco Santander SA, 2.17%, 03/10/2022	100.000	1,23
		Spanien - Gesamt	100.000	1,23
150.000.000	GBP	Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 4,92 %) UK Debt Management Office, 2.00%, 03/10/2022	150.000	1,85
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	150.000	1,85
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 3,02 %)	-	-
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			2.501.801	30,90

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 1,16 %)				
35.000.000	GBP	Australien (30. September 2021: 0,00 %) Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 3.19%, 01/02/2023	35.088	0,44
43.000.000	GBP	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 2.50%, 27/06/2023	42.941	0,53
43.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., FRN, 2.51%, 23/06/2023	42.944	0,53
27.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., FRN, 2.51%, 24/06/2023	26.965	0,33
		Australien - Gesamt	147.938	1,83

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
Kanada (30. September 2021: 1,16 %)				
58.000.000	GBP	Bank of Montreal, FRN, 2.50%, 09/06/2023	57.907	0,71
75.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.19%, 01/02/2023	75.122	0,93
68.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.19%, 03/02/2023	68.112	0,84
80.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.19%, 08/02/2023	80.137	0,99
74.000.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.19%, 17/01/2023	74.104	0,92
87.000.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 2.53%, 07/07/2023	86.892	1,07
41.000.000	GBP	National Bank of Canada, FRN, 3.19%, 14/02/2023	41.074	0,51
33.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 3.20%, 25/01/2023	33.050	0,41
44.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 3.19%, 18/05/2023	44.138	0,54
75.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 3.20%, 06/07/2023	75.151	0,93
70.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 3.19%, 22/09/2023	70.354	0,87
Kanada - Gesamt			706.041	8,72
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			853.979	10,55
Anlagen in Anleihen - Gesamt			853.979	10,55

Bestand	Währung	Kontrahent	Zins- sätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (30. September 2021: 11,10 %)						
Australien (30. September 2021: 3,02 %)						
					-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 8,08 %)						
100.166.833	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	04.10.2022	100.166	1,24
200.000.000	GBP	Barclays Bank plc	2,10 %	03.10.2022	200.000	2,47
193.000.000	GBP	BNP Paribas SA	2,05 %	03.10.2022	193.000	2,38
103.635.515	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,10 %	04.10.2022	103.635	1,28
258.153.830	GBP	Santander UK plc	2,10 %	03.10.2022	258.154	3,19
59.449.046	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	59.449	0,73
41.118.749	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	41.119	0,51
103.799.874	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	103.800	1,28
Vereinigtes Königreich - Gesamt					1.059.323	13,08
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					1.059.323	13,08

	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt	8.174.233	100,96
Zahlungsmittel	165.027	2,04
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(243.023)	(3,00)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert	8.096.237	100,00

	% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	10,21
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	12,67
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)	74,87
Sonstige Vermögenswerte	2,25
Gesamtvermögen	100,00

BLACKROCK ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

²Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 1.088.038.000 GBP.

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2021: 44,89 %)				
Australien (30. September 2021: 2,48 %)				
100.000.000	GBP	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 2.35%, 03/01/2023 ¹	99.413	0,29
335.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 0.76%, 07/11/2022 ¹	334.758	1,00
284.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., 2.00%, 06/02/2023	284.000	0,85
		Australien - Gesamt	718.171	2,14
Belgien (30. September 2021: 0,00 %)				
315.000.000	GBP	BNP Paribas Fortis SA, 2.90%, 20/12/2022	315.000	0,94
		Belgien - Gesamt	315.000	0,94
Kanada (30. September 2021: 6,78 %)				
295.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 0.80%, 21/10/2022	295.000	0,88
500.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 0.75%, 24/10/2022	500.000	1,49
420.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 0.79%, 07/11/2022	420.000	1,25
300.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 2.00%, 21/02/2023 ¹	297.717	0,89
		Kanada - Gesamt	1.512.717	4,51
Finnland (30. September 2021: 1,69 %)				
162.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 0.70%, 28/10/2022 ¹	161.923	0,49
403.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 2.58%, 25/01/2023 ¹	399.794	1,19
395.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 2.58%, 06/02/2023 ¹	391.528	1,17
84.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 1.98%, 09/02/2023	84.000	0,25
		Finnland - Gesamt	1.037.245	3,10
Frankreich (30. September 2021: 3,36 %)				
270.000.000	GBP	BNP Paribas SA, 1.78%, 10/10/2022	270.000	0,80
265.000.000	GBP	BNP Paribas UK Holdings Ltd., 1.75%, 07/10/2022	265.000	0,79
240.000.000	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 1.75%, 10/10/2022 ¹	239.920	0,72
		Frankreich - Gesamt	774.920	2,31
Japan (30. September 2021: 10,83 %)				
150.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 1.75%, 03/10/2022	150.000	0,45
75.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 1.78%, 06/10/2022	75.000	0,22
50.000.000	GBP	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 1.80%, 11/10/2022	50.000	0,15
200.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.72%, 03/10/2022 ¹	200.000	0,60
138.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.84%, 03/10/2022	138.000	0,41
90.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.72%, 03/10/2022	90.000	0,27
90.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.75%, 04/10/2022	90.000	0,27
63.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.75%, 04/10/2022 ¹	62.997	0,19
75.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.75%, 05/10/2022	75.000	0,22
123.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.75%, 06/10/2022	123.000	0,37
50.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.84%, 06/10/2022	50.000	0,15
50.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 1.84%, 07/10/2022	50.000	0,15
220.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 2.53%, 08/11/2022	220.000	0,66
69.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 2.53%, 10/11/2022 ¹	68.819	0,20
100.000.000	GBP	MUFG Bank Ltd., 2.30%, 27/10/2022	100.000	0,30
490.000.000	GBP	MUFG Bank Ltd., 2.19%, 09/11/2022	490.000	1,46
51.000.000	GBP	Norinchukin Bank (The), 1.75%, 06/10/2022 ¹	50.993	0,15
20.000.000	GBP	Norinchukin Bank (The), 2.29%, 12/10/2022 ¹	19.989	0,06
125.000.000	GBP	Norinchukin Bank (The), 1.99%, 21/10/2022 ¹	124.878	0,37
80.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 2.05%, 27/10/2022 ¹	79.893	0,24
190.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 2.09%, 28/10/2022 ¹	189.729	0,57
80.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.10%, 07/10/2022	80.000	0,24
125.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.11%, 07/11/2022	125.000	0,37
90.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.19%, 09/11/2022	90.000	0,27
92.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.19%, 10/11/2022	92.000	0,27

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
380.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.19%, 14/11/2022	380.000	1,13
		Japan - Gesamt	3.265.298	9,74
Luxemburg (30. September 2021: 0,00 %)				
196.000.000	GBP	DNB Luxembourg SA, 2.52%, 08/02/2023	196.000	0,59
		Luxemburg - Gesamt	196.000	0,59
Niederlande (30. September 2021: 2,17 %)				
460.000.000	GBP	ING Bank NV, 2.55%, 06/02/2023 ¹	456.002	1,36
		Niederlande - Gesamt	456.002	1,36
Norwegen (30. September 2021: 0,00 %)				
196.000.000	GBP	DNB Bank ASA, 2.53%, 08/02/2023	196.000	0,59
		Norwegen - Gesamt	196.000	0,59
Singapur (30. September 2021: 3,23 %)				
95.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 1.65%, 03/10/2022 ¹	95.000	0,28
405.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 1.80%, 14/10/2022 ¹	404.781	1,21
400.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 2.75%, 16/12/2022 ¹	397.785	1,19
80.000.000	GBP	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 2.71%, 16/12/2022	80.000	0,24
30.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 1.74%, 11/10/2022	30.000	0,09
25.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 1.76%, 12/10/2022	25.000	0,08
75.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 1.95%, 21/10/2022	75.000	0,22
65.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.68%, 13/12/2022	65.000	0,19
40.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.35%, 03/01/2023	40.000	0,12
50.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.31%, 13/01/2023	50.000	0,15
40.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.50%, 03/02/2023	40.000	0,12
50.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.55%, 08/02/2023	50.000	0,15
50.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.55%, 09/02/2023	50.000	0,15
40.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.59%, 10/02/2023	40.000	0,12
45.000.000	GBP	United Overseas Bank Ltd., 2.78%, 17/02/2023	45.000	0,13
		Singapur - Gesamt	1.487.566	4,44
Schweden (30. September 2021: 2,15 %)				
180.000.000	GBP	Handelsbanken plc, 1.73%, 10/10/2022	180.000	0,54
124.000.000	GBP	Handelsbanken plc, 1.75%, 11/10/2022	124.000	0,37
120.000.000	GBP	Handelsbanken plc, 1.90%, 06/01/2023	120.000	0,36
		Schweden - Gesamt	424.000	1,27
Schweiz (30. September 2021: 3,14 %)				
100.000.000	GBP	UBS AG, 0.77%, 22/10/2022	100.000	0,30
77.000.000	GBP	UBS AG, 2.31%, 13/01/2023	77.000	0,23
54.000.000	GBP	UBS AG, 2.32%, 13/01/2023	54.000	0,16
146.000.000	GBP	UBS AG, 2.00%, 24/02/2023	146.000	0,43
164.000.000	GBP	UBS, Inc., 2.00%, 23/02/2023	164.000	0,49
		Schweiz - Gesamt	541.000	1,61
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 8,36 %)				
75.000.000	GBP	ICAP Securities Ltd., 2.85%, 15/12/2022	75.000	0,22
823.000.000	GBP	Nationwide Building Society, 2.19%, 05/10/2022	823.000	2,46
268.000.000	GBP	Standard Chartered Bank, 2.00%, 07/11/2022	268.000	0,80
229.000.000	GBP	Standard Chartered Bank, 2.17%, 05/12/2022	229.000	0,68
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	1.395.000	4,16

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,70 %)				
78.000.000	GBP	Bank of America NA, 2.45%, 03/02/2023 ¹	77.364	0,23
		Vereinigte Staaten - Gesamt	77.364	0,23
Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt			12.396.283	36,99
Commercial Papers (30. September 2021: 28,79 %)				
Finnland (30. September 2021: 1,95 %)				
162.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 0.69%, 27/10/2022 ¹	161.926	0,48
250.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 1.97%, 06/02/2023 ¹	248.299	0,74
160.000.000	GBP	Nordea Bank Abp, 1.97%, 06/02/2023 ¹	158.912	0,48
175.000.000	GBP	OP Corporate Bank plc, 2.36%, 09/01/2023 ¹	173.889	0,52
		Finnland - Gesamt	743.026	2,22
Frankreich (30. September 2021: 10,98 %)				
240.000.000	GBP	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 1.86%, 03/10/2022 ¹	240.000	0,72
15.000.000	GBP	Antalis SA, 2.44%, 24/10/2022 ¹	14.978	0,04
392.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.42%, 16/01/2023 ¹	389.268	1,16
390.000.000	GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.40%, 09/03/2023 ¹	384.318	1,15
60.000.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 2.17%, 06/10/2022 ¹	59.989	0,18
80.000.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 2.37%, 20/10/2022 ¹	79.911	0,24
		Frankreich - Gesamt	1.168.464	3,49
Deutschland (30. September 2021: 2,75 %)				
390.000.000	GBP	DZ Bank AG, 2.28%, 13/01/2023 ¹	387.511	1,16
194.000.000	GBP	DZ Bank AG, 2.42%, 17/01/2023 ¹	192.635	0,57
196.000.000	GBP	DZ Bank AG, 2.51%, 01/02/2023 ¹	194.371	0,58
		Deutschland - Gesamt	774.517	2,31
Irland (30. September 2021: 1,03 %)				
30.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 2.27%, 12/10/2022 ¹	29.983	0,09
106.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 2.27%, 17/10/2022 ¹	105.906	0,31
19.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 2.30%, 17/10/2022 ¹	18.983	0,06
201.000.000	GBP	Matchpoint Finance plc, 2.37%, 20/10/2022 ¹	200.776	0,60
		Irland - Gesamt	355.648	1,06
Japan (30. September 2021: 3,62 %)				
135.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 2.07%, 07/11/2022 ¹	134.730	0,40
500.000.000	GBP	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 2.07%, 08/11/2022 ¹	498.970	1,49
		Japan - Gesamt	633.700	1,89
Luxemburg (30. September 2021: 0,80 %)				
20.000.000	GBP	Albion Capital Corp. SA, 2.13%, 05/10/2022 ¹	19.998	0,06
172.198.000	GBP	Albion Capital Corp. SA, 2.37%, 20/10/2022 ¹	172.006	0,51
42.000.000	GBP	Albion Capital Corp. SA, 2.22%, 25/10/2022 ¹	41.943	0,13
50.000.000	GBP	Sunderland Receivables SA, 2.37%, 20/10/2022 ¹	49.944	0,15
		Luxemburg - Gesamt	283.891	0,85
Niederlande (30. September 2021: 3,07 %)				
775.000.000	GBP	Kingdom of The Netherlands, 2.25%, 03/10/2022 ¹	775.000	2,31
2.000.000	GBP	PACCAR Financial Europe BV, 2.27%, 20/10/2022 ¹	1.998	0,01
		Niederlande - Gesamt	776.998	2,32

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
		Supranational (30. September 2021: 1,28 %)	-	-
		Schweden (30. September 2021: 1,67 %)	-	-
123.000.000	GBP	Schweiz (30. September 2021: 1,07 %) UBS AG, 1.97%, 24/02/2023 ¹	122.044	0,36
		Schweiz - Gesamt	122.044	0,36
74.000.000	GBP	Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 0,00 %) Barclays Bank UK plc, 2.16%, 03/10/2022 ¹	74.000	0,22
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	74.000	0,22
156.600.000	GBP	Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,57 %) Manhattan Asset Funding Co. LLC, 2.37%, 20/10/2022 ¹	156.425	0,46
50.259.000	GBP	Mont Blanc Capital Corp., 2.32%, 18/10/2022 ¹	50.211	0,15
10.000.000	GBP	Sheffield Receivables Co. LLC, 2.37%, 20/10/2022 ¹	9.989	0,03
		Vereinigte Staaten - Gesamt	216.625	0,64
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			5.148.913	15,36
Termineinlagen (30. September 2021: 9,99 %)				
250.946.436	GBP	Österreich (30. September 2021: 0,00 %) Erste Group Bank AG, 2.17%, 03/10/2022	250.946	0,75
		Österreich - Gesamt	250.946	0,75
19.000.000	GBP	Belgien (30. September 2021: 0,00 %) KBC Bank NV, 2.17%, 03/10/2022	19.000	0,06
		Belgien - Gesamt	19.000	0,06
300.000.000	GBP	Kanada (30. September 2021: 0,00 %) Bank of Nova Scotia (The), 2.19%, 03/10/2022	300.000	0,90
		Kanada - Gesamt	300.000	0,90
151.063.952	GBP	Frankreich (30. September 2021: 0,82 %) BRED Banque Populaire, 2.19%, 03/10/2022	151.064	0,45
100.000.000	GBP	BRED Banque Populaire, 2.19%, 03/10/2022	100.000	0,30
200.000.000	GBP	Credit Mutuel, 2.10%, 03/10/2022	200.000	0,59
100.000.000	GBP	Societe Generale SA, 2.25%, 03/10/2022	100.000	0,30
		Frankreich - Gesamt	551.064	1,64
650.076.934	GBP	Deutschland (30. September 2021: 0,00 %) DZ Bank AG, 2.16%, 03/10/2022	650.077	1,94
		Deutschland - Gesamt	650.077	1,94
100.856.388	GBP	Japan (30. September 2021: 5,53 %) Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 2.18%, 03/10/2022	100.856	0,30
450.000.000	GBP	Mizuho Bank Ltd., 2.18%, 03/10/2022	450.000	1,34
200.023.891	GBP	MUFG Bank Ltd., 2.20%, 03/10/2022	200.024	0,60
1.005.195.432	GBP	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 2.20%, 03/10/2022	1.005.196	3,00
		Japan - Gesamt	1.756.076	5,24

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (Fortsetzung)				
690.000.000	GBP	Spanien (30. September 2021: 0,61 %) Banco Santander SA, 2.17%, 03/10/2022	690.000	2,06
		Spanien - Gesamt	690.000	2,06
550.000.000	GBP	Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 1,66 %) Rabobank International, 2.20%, 03/10/2022	550.000	1,64
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	550.000	1,64
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 1,37 %)	-	-
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			4.767.163	14,23
Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2021: 1,35 %)				
151.000.000	GBP	Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 1,35 %) UK Treasury Bill, 1.57%, 10/10/2022 ¹	150.955	0,45
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	150.955	0,45
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			150.955	0,45
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 1,84 %)				
201.000.000	GBP	Australien (30. September 2021: 0,00 %) Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 3.19%, 01/02/2023	201.618	0,60
197.000.000	GBP	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 2.50%, 27/06/2023	197.000	0,59
197.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., FRN, 2.51%, 23/06/2023	197.000	0,59
127.000.000	GBP	National Australia Bank Ltd., FRN, 2.51%, 24/06/2023	127.000	0,38
		Australien - Gesamt	722.618	2,16
288.500.000	GBP	Kanada (30. September 2021: 1,84 %) Bank of Montreal, FRN, 2.50%, 09/06/2023	288.500	0,86
425.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.19%, 01/02/2023	426.251	1,27
405.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.19%, 03/02/2023	406.219	1,21
450.000.000	GBP	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.19%, 08/02/2023	451.402	1,35
448.000.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.19%, 17/01/2023	449.197	1,34
392.000.000	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 2.53%, 07/07/2023	392.000	1,17
243.000.000	GBP	National Bank of Canada, FRN, 3.19%, 14/02/2023	243.782	0,73
203.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 3.20%, 25/01/2023	203.581	0,61
225.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 3.19%, 18/05/2023	225.974	0,67
295.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 3.20%, 06/07/2023	296.484	0,89
320.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, FRN, 3.19%, 22/09/2023	322.056	0,96
		Kanada - Gesamt	3.705.446	11,06

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,00 %)		
500.000.000	GBP	New York Life Global Funding, FRN, 2.51%, 01/09/2023	500.000	1,49
		Vereinigte Staaten - Gesamt	500.000	1,49
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			4.928.064	14,71
Anlagen in Anleihen - Gesamt			5.079.019	15,16

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (30. September 2021: 14,42 %)						
Australien (30. September 2021: 0,14 %)						
					-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 14,28 %)						
117.051.856	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	117.052	0,35
75.125.154	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	75.125	0,22
63.379.394	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	63.379	0,19
61.162.874	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	61.163	0,18
50.173.917	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	50.174	0,15
36.927.653	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	36.928	0,11
30.257.726	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	30.258	0,09
18.354.932	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	18.355	0,05
18.105.955	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	18.106	0,05
12.189.685	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	12.190	0,04
9.269.647	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	9.270	0,03
8.960.928	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	8.961	0,03
1.559.722	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	1.560	-
1.267.431	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	1.267	-
1.197.209	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	03.10.2022	1.197	-
299.507.298	GBP	Bank of Nova Scotia plc	2,10 %	04.10.2022	299.508	0,91
100.000.000	GBP	Barclays Bank plc	2,10 %	03.10.2022	100.000	0,30
150.000.000	GBP	BNP Paribas SA	2,05 %	03.10.2022	150.000	0,45
53.494.157	GBP	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,10 %	04.10.2022	53.494	0,16
500.000.000	GBP	Citigroup Global Markets Ltd.	2,08 %	03.10.2022	500.000	1,49
300.000.000	GBP	Citigroup Global Markets Ltd.	2,08 %	03.10.2022	300.000	0,89
50.886.170	GBP	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	2,10 %	03.10.2022	50.886	0,15
		Credit Agricole Corporate and Investment Bank				
101.701.899	GBP	Bank	2,15 %	04.10.2022	101.702	0,30
100.000.000	GBP	HSBC Bank plc	2,00 %	03.10.2022	100.000	0,30
51.314.040	GBP	Merrill Lynch International	1,97 %	03.10.2022	51.314	0,15
51.314.040	GBP	Merrill Lynch International	1,97 %	03.10.2022	51.314	0,15
51.314.040	GBP	Merrill Lynch International	1,97 %	03.10.2022	51.314	0,15
98.248.975	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	98.249	0,29
87.627.966	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	87.628	0,26
84.228.914	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	84.229	0,25
80.218.013	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	80.218	0,24
74.067.972	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	74.068	0,22
61.638.507	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	61.639	0,18
61.520.887	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	61.521	0,18
30.756.484	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	30.756	0,09
28.890.115	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,09 %	03.10.2022	28.890	0,09

BLACKROCK ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (Fortsetzung)						
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)						
598.085.377	GBP	MUFG Securities EMEA plc	2,10 %	04.10.2022	598.084	1,78
481.936.088	GBP	Santander UK plc	2,10 %	03.10.2022	481.936	1,44
444.444.476	GBP	Santander UK plc	2,10 %	03.10.2022	444.444	1,33
162.936.459	GBP	Santander UK plc	2,10 %	03.10.2022	162.936	0,49
115.880.605	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	115.881	0,35
113.346.748	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	113.347	0,34
97.213.885	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	97.214	0,29
82.349.736	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	82.350	0,25
66.049.743	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	66.050	0,20
47.418.525	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	47.419	0,14
29.776.049	GBP	Standard Chartered Bank	2,10 %	03.10.2022	29.776	0,09
106.159.008	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	106.159	0,32
106.159.008	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	106.159	0,32
106.159.008	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	106.159	0,32
106.159.008	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	106.159	0,32
106.159.008	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	106.159	0,32
106.032.130	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	106.032	0,32
100.451.491	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	100.451	0,30
97.992.930	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	97.993	0,29
85.081.467	GBP	Toronto-Dominion Bank (The)	2,10 %	03.10.2022	85.081	0,25
Vereinigtes Königreich - Gesamt					6.081.504	18,15
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					6.081.504	18,15
					Zeitwert	% des Netto-
					Tsd. GBP	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					33.472.882	99,89
Zahlungsmittel					991.797	2,96
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(955.092)	(2,85)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					33.509.587	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						Gesamt-
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						vermögens
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)						14,23
Sonstige Vermögenswerte						17,99
						64,41
						3,37
Gesamtvermögen						100,00

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

²Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 6.195.892.000 GBP.

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (30. September 2021: 25,49 %)				
60.000.000	GBP	Australien (30. September 2021: 0,00 %) National Australia Bank Ltd., 2.00%, 06/02/2023	59.643	3,68
		Australien - Gesamt	59.643	3,68
		Belgien (30. September 2021: 3,47 %)	-	-
62.000.000	GBP	Kanada (30. September 2021: 0,00 %) Bank of Montreal, 3.10%, 07/08/2023	61.101	3,77
70.000.000	GBP	Royal Bank of Canada, 3.12%, 18/07/2023 ¹	67.515	4,16
60.000.000	GBP	Toronto-Dominion Bank (The), 0.80%, 21/10/2022	59.962	3,70
		Kanada - Gesamt	188.578	11,63
70.000.000	GBP	Finnland (30. September 2021: 0,00 %) Nordea Bank Abp, 2.50%, 03/02/2023 ¹	69.126	4,26
		Finnland - Gesamt	69.126	4,26
70.000.000	GBP	Frankreich (30. September 2021: 3,70 %) Societe Generale SA, 0.89%, 11/01/2023 ¹	69.320	4,28
		Frankreich - Gesamt	69.320	4,28
64.000.000	GBP	Japan (30. September 2021: 2,71 %) Sumitomo Mitsui Banking Corp., 2.11%, 14/10/2022 ¹	63.942	3,94
50.000.000	GBP	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.10%, 07/10/2022	49.998	3,09
		Japan - Gesamt	113.940	7,03
		Spanien (30. September 2021: 4,26 %)	-	-
70.000.000	GBP	Schweiz (30. September 2021: 5,10 %) Credit Suisse AG, 0.71%, 07/12/2022	69.707	4,30
75.000.000	GBP	UBS AG, 0.71%, 25/11/2022 ¹	74.673	4,60
		Schweiz - Gesamt	144.380	8,90
40.000.000	GBP	Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 6,25 %) Goldman Sachs International Bank, 2.29%, 05/05/2023 ¹	39.135	2,41
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	39.135	2,41
		Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt	684.122	42,19
Commercial Papers (30. September 2021: 31,37 %)				
70.000.000	GBP	Australien (30. September 2021: 0,00 %) Macquarie Bank Ltd., 2.26%, 26/05/2023 ¹	67.766	4,18
		Australien - Gesamt	67.766	4,18
36.000.000	CAD	Kanada (30. September 2021: 1,99 %) Enbridge Gas, Inc., 3.21%, 07/10/2022 ¹	23.462	1,45
		Kanada - Gesamt	23.462	1,45
60.000.000	GBP	Dänemark (30. September 2021: 3,47 %) Nykredit Bank A/S, 2.87%, 09/01/2023 ¹	59.381	3,66
		Dänemark - Gesamt	59.381	3,66

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Frankreich (30. September 2021: 5,80 %)				
60.000.000	GBP	La Banque Postale SA, 2.97%, 26/01/2023 ¹	59.383	3,66
34.600.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 1.62%, 03/10/2022 ¹	34.594	2,13
51.000.000	GBP	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 1.62%, 04/10/2022 ¹	50.997	3,15
		Frankreich - Gesamt	144.974	8,94
		Luxemburg (30. September 2021: 2,91 %)	-	-
		Niederlande (30. September 2021: 6,23 %)	-	-
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 8,82 %)				
50.000.000	EUR	Brambles Finance plc, 0.93%, 27/10/2022 ¹	43.842	2,70
14.000.000	EUR	Brambles Finance plc, 0.50%, 01/11/2022 ¹	12.274	0,76
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	56.116	3,46
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 2,15 %)				
65.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 3.70%, 28/10/2022 ¹	58.072	3,58
46.000.000	EUR	Realty Income Corp., 0.97%, 14/10/2022 ¹	40.351	2,49
13.000.000	EUR	Realty Income Corp., 0.93%, 09/11/2022 ¹	11.394	0,70
		Vereinigte Staaten - Gesamt	109.817	6,77
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			461.516	28,46
Termineinlagen (30. September 2021: 10,15 %)				
Belgien (30. September 2021: 3,20 %)				
			-	-
Japan (30. September 2021: 6,95 %)				
140.058.540	GBP	MUFG Bank Ltd., 2.20%, 03/10/2022	140.059	8,63
		Japan - Gesamt	140.059	8,63
Spanien (30. September 2021: 0,00 %)				
129.700.000	GBP	Banco Santander SA, 2.17%, 03/10/2022	129.700	8,00
		Spanien - Gesamt	129.700	8,00
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			269.759	16,63
Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 26,44 %)				
Australien (30. September 2021: 3,04 %)				
			-	-
Kanada (30. September 2021: 2,12 %)				
			-	-
Frankreich (30. September 2021: 2,68 %)				
26.200.000	GBP	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 1.00%, 11/02/2023	25.889	1,59
		Frankreich - Gesamt	25.889	1,59

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
		Deutschland (30. September 2021: 2,33 %)	-	-
100.000.000	GBP	Niederlande (30. September 2021: 10,21 %) Toyota Motor Finance Netherlands BV, FRN, 2.59%, 28/04/2023	100.034	6,17
		Niederlande - Gesamt	100.034	6,17
		Schweden (30. September 2021: 0,94 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 5,12 %)	-	-
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			125.923	7,76
Anlagen in Anleihen - Gesamt			125.923	7,76

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte²				
Buy GBP 23,735,930; Sell CAD 36,000,000	Standard Chartered	07.10.2022	267	0,02
Buy GBP 43,939,659; Sell EUR 50,000,000	Morgan Stanley	27.10.2022	12	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2021: 0,00 %)³			279	0,02

Devisenterminkontrakte²				
Buy GBP 32,832; Sell EUR 37,765 ⁴	RBC	14.10.2022	-	-
Buy GBP 39,960,004; Sell EUR 45,962,235	Toronto-Dominion Bank	14.10.2022	(395)	(0,03)
Buy GBP 15,024; Sell EUR 17,866	BNP Paribas	01.11.2022	(1)	-
Buy GBP 11,758,580; Sell EUR 13,982,134	Barclays	01.11.2022	(529)	(0,03)
Buy GBP 18,170; Sell EUR 20,892 ⁴	Standard Chartered	09.11.2022	-	-
Buy GBP 11,287,917; Sell EUR 12,979,108	Societe Generale	09.11.2022	(124)	(0,01)
Buy GBP 473,760; Sell USD 572,000	Standard Chartered	28.10.2022	(38)	-
Buy GBP 53,365,626; Sell USD 64,428,000	RBC	28.10.2022	(4.319)	(0,27)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2021: (0,19) %)			(5.406)	(0,34)

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. GBP	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt				
			1.541.599	95,06
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt				
			(5.406)	(0,34)
Zahlungsmittel				
			60.204	3,71
Zahlungsmitteläquivalente				
Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (30. September 2021: 4,40 %)				
70.000.000	GBP	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis) ⁵	70.000	4,32
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt			70.000	4,32
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			(44.715)	(2,75)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert			1.621.682	100,00

BLACKROCK ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

	% des Gesamt- vermögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind	7,49
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)	84,16
Investmentfonds (CIS)	4,16
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,02
Sonstige Vermögenswerte	4,17
Gesamtvermögen	<u>100,00</u>

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

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.

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

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

⁵Dem Fonds nahestehende Partei.

	Basisengagement TSD. GBP
Derivative Finanzinstrumente	
Devisenterminkontrakte	189.642

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2021: 25,90 %)				
		Australien (30. September 2021: 2,14 %)	-	-
		Belgien (30. September 2021: 0,38 %)	-	-
		Kanada (30. September 2021: 5,11 %)		
22.700.000	USD	Bank of Montreal, FRN, 3.46%, 05/05/2023	22.715	0,56
12.000.000	USD	Bank of Montreal, FRN, 3.61%, 03/07/2023	12.016	0,30
19.000.000	USD	Bank of Montreal, 3.13%, 07/10/2022 ¹	18.994	0,47
22.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.36%, 12/12/2022	22.006	0,54
40.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.47%, 16/03/2023	40.026	0,98
21.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.46%, 28/03/2023	21.015	0,52
10.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.46%, 05/05/2023	10.006	0,25
9.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.54%, 12/05/2023	9.009	0,22
18.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.36%, 14/11/2022	18.004	0,44
15.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.26%, 06/01/2023	15.002	0,37
10.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.47%, 15/03/2023	10.008	0,25
24.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.46%, 08/05/2023	24.019	0,59
25.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.61%, 03/07/2023	25.032	0,62
14.000.000	USD	Royal Bank of Canada, FRN, 3.61%, 03/07/2023	14.015	0,34
12.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 4.00%, 13/07/2023	11.935	0,29
15.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 4.09%, 25/08/2023	14.907	0,37
20.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.02%, 02/11/2022 ¹	19.950	0,49
18.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.36%, 10/11/2022	18.004	0,44
11.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.49%, 09/03/2023	11.008	0,27
12.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.70%, 01/05/2023	11.943	0,29
10.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.80%, 08/05/2023	9.895	0,24
20.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.53%, 02/06/2023	20.012	0,49
20.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.90%, 06/06/2023	19.762	0,49
6.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 4.13%, 24/08/2023 ¹	5.753	0,14
9.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 4.12%, 28/08/2023	8.945	0,22
10.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 4.35%, 13/09/2023	9.955	0,25
		Kanada - Gesamt	423.936	10,43
		Finnland (30. September 2021: 0,00 %)		
11.200.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.17%, 27/10/2022	11.200	0,28
11.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.17%, 28/10/2022	11.000	0,27
14.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.17%, 01/11/2022	14.001	0,34
25.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.18%, 15/11/2022	24.999	0,61
30.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.36%, 23/11/2022	30.008	0,74
10.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.38%, 23/12/2022	10.004	0,25
13.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.54%, 02/03/2023	13.013	0,32
		Finnland - Gesamt	114.225	2,81
		Frankreich (30. September 2021: 2,21 %)		
5.000.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.93%, 09/02/2023 ¹	4.927	0,12
13.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 3.55%, 06/03/2023	13.018	0,32
12.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 3.46%, 17/03/2023	12.011	0,29
11.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 3.05%, 28/11/2022	10.996	0,27
10.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 4.70%, 20/09/2023	9.995	0,25
17.000.000	USD	Natixis SA, FRN, 3.24%, 07/02/2023	17.000	0,42
		Frankreich - Gesamt	67.947	1,67
		Deutschland (30. September 2021: 0,00 %)		
13.500.000	USD	DG Bank, 3.06%, 04/10/2022	13.500	0,33
		Deutschland - Gesamt	13.500	0,33
		Japan (30. September 2021: 5,96 %)		
15.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 3.23%, 03/01/2023	15.001	0,37

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
12.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 3.48%, 17/03/2023	12.004	0,30
15.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 3.34%, 06/01/2023 ¹	14.850	0,36
9.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.30%, 21/10/2022 ¹	8.983	0,22
21.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.09%, 27/10/2022	21.000	0,52
		Japan - Gesamt	71.838	1,77
Niederlande (30. September 2021: 2,34 %)				
18.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 3.14%, 24/10/2022	18.000	0,44
20.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 3.15%, 08/11/2022	20.000	0,49
		Niederlande - Gesamt	38.000	0,93
Norwegen (30. September 2021: 0,00 %)				
8.000.000	USD	DNB Bank ASA, 4.00%, 01/06/2023 ¹	7.766	0,19
		Norwegen - Gesamt	7.766	0,19
Singapur (30. September 2021: 2,24 %)				
			-	-
Spanien (30. September 2021: 0,00 %)				
10.000.000	USD	Banco Santander SA, FRN, 3.43%, 19/10/2022	10.002	0,25
		Spanien - Gesamt	10.002	0,25
Schweden (30. September 2021: 0,00 %)				
16.400.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.17%, 27/10/2022	16.400	0,40
25.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.49%, 28/03/2023	25.023	0,62
22.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.64%, 03/07/2023	22.034	0,54
		Schweden - Gesamt	63.457	1,56
Schweiz (30. September 2021: 1,68 %)				
32.000.000	USD	Credit Suisse AG, FRN, 3.24%, 10/02/2023	31.994	0,79
15.000.000	USD	Credit Suisse AG, 0.38%, 01/11/2022	14.963	0,37
		Schweiz - Gesamt	46.957	1,16
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 3,84 %)				
14.000.000	USD	Barclays Bank plc, FRN, 3.28%, 15/02/2023	13.998	0,34
25.000.000	USD	Barclays Bank plc, FRN, 3.60%, 05/04/2023	25.030	0,62
25.000.000	USD	Barclays Bank plc, 2.05%, 31/10/2022 ¹	24.934	0,61
12.500.000	USD	Barclays Bank plc, 2.98%, 01/06/2023	12.372	0,30
8.000.000	USD	Barclays Bank plc, 4.02%, 21/07/2023	7.959	0,20
5.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 0.46%, 02/11/2022 ¹	4.986	0,12
10.200.000	USD	Lloyds Bank Corporate Markets plc, FRN, 3.25%, 24/01/2023	10.204	0,25
10.000.000	USD	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.40%, 01/12/2022	9.948	0,25
12.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 3.56%, 01/03/2023	12.011	0,30
14.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 3.26%, 13/03/2023	13.996	0,34
14.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 3.25%, 02/11/2022 ¹	13.961	0,34
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	149.399	3,67
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,00 %)				
12.000.000	USD	Citibank NA, FRN, 3.33%, 03/01/2023	12.000	0,29
19.000.000	USD	Citibank NA, 3.77%, 01/05/2023	18.923	0,47
25.000.000	USD	Citibank NA, 3.82%, 03/07/2023	24.838	0,61
10.000.000	USD	Citibank NA, 3.92%, 27/07/2023	9.931	0,24
15.000.000	USD	Citibank NA, 4.06%, 01/08/2023	14.909	0,37
4.000.000	USD	Citibank NA, 4.16%, 25/08/2023	3.975	0,10

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
10.000.000	USD	Citibank NA, 4.16%, 01/09/2023	9.934	0,24
		Vereinigte Staaten - Gesamt	94.510	2,32
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			1.101.537	27,09
Commercial Papers (30. September 2021: 49,84 %)				
Australien (30. September 2021: 2,84 %)				
15.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 3.29%, 13/10/2022	15.001	0,37
25.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 3.41%, 21/02/2023	25.020	0,61
10.000.000	USD	Macquarie Bank Ltd., 3.33%, 10/01/2023	10.004	0,25
40.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., 3.46%, 14/03/2023	40.027	0,98
10.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 0.34%, 20/10/2022 ¹	9.983	0,25
20.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 3.38%, 20/12/2022	20.010	0,49
15.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 3.39%, 06/01/2023	15.009	0,37
10.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 3.41%, 28/03/2023	10.005	0,25
8.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 4.24%, 30/08/2023 ¹	7.651	0,19
		Australien - Gesamt	152.710	3,76
Österreich (30. September 2021: 1,89 %)				
20.000.000	USD	Erste Group Bank AG, 3.20%, 06/10/2022 ¹	19.991	0,49
		Österreich - Gesamt	19.991	0,49
Belgien (30. September 2021: 2,89 %)				
44.000.000	USD	Kingdom of Belgium, 3.06%, 07/10/2022 ¹	43.974	1,08
12.000.000	USD	Kingdom of Belgium, 3.10%, 11/10/2022 ¹	11.989	0,30
		Belgien - Gesamt	55.963	1,38
Kanada (30. September 2021: 3,93 %)				
9.000.000	USD	Bank of Montreal, 4.01%, 12/07/2023 ¹	8.686	0,21
12.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), 3.47%, 03/01/2023	12.009	0,30
15.000.000	USD	CDP Financial, Inc., 4.19%, 21/08/2023 ¹	14.379	0,35
20.000.000	USD	National Bank of Canada, 3.36%, 10/11/2022	20.004	0,49
20.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 3.41%, 03/01/2023	20.013	0,49
14.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 3.49%, 04/01/2023	14.011	0,35
15.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.48%, 31/03/2023	15.009	0,37
		Kanada - Gesamt	104.111	2,56
Cayman-Inseln (30. September 2021: 0,78 %)				
15.000.000	USD	Alpine Securitization Ltd., 3.38%, 04/11/2022	15.003	0,37
20.000.000	USD	Alpine Securitization Ltd., 3.51%, 21/02/2023	20.008	0,49
		Cayman-Inseln - Gesamt	35.011	0,86
Finnland (30. September 2021: 1,41 %)				
			-	-
Frankreich (30. September 2021: 10,49 %)				
10.000.000	USD	Antalis SA, 3.30%, 24/10/2022 ¹	9.978	0,25
20.000.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.21%, 09/01/2023 ¹	19.790	0,49
40.000.000	USD	BNP Paribas SA, 3.36%, 24/10/2022	40.007	0,98
28.000.000	USD	BNP Paribas SA, 3.36%, 04/11/2022	28.006	0,69
20.000.000	USD	BPCE SA, 1.42%, 22/02/2023 ¹	19.676	0,48
20.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 3.89%, 06/01/2023 ¹	19.779	0,49
29.000.000	USD	Caisse des depots et consignations, 3.11%, 03/11/2022 ¹	28.915	0,71
55.000.000	USD	La Banque Postale SA, 3.05%, 03/10/2022 ¹	54.986	1,35
55.000.000	USD	La Banque Postale SA, 0.00%, 04/10/2022 ¹	54.995	1,35

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
25.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 2.70%, 03/10/2022 ¹	24.993	0,61
15.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 3.14%, 03/10/2022 ¹	14.996	0,37
15.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 04/10/2022 ¹	14.999	0,37
10.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 3.27%, 31/10/2022 ¹	9.973	0,25
25.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 02/11/2022 ¹	24.927	0,61
10.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 3.20%, 07/11/2022 ¹	9.966	0,24
20.000.000	USD	Satellite, 2.70%, 03/10/2022 ¹	19.995	0,49
10.000.000	USD	Satellite, 3.25%, 19/10/2022 ¹	9.983	0,25
5.000.000	USD	Satellite, 0.00%, 02/11/2022 ¹	4.986	0,12
15.000.000	USD	Satellite, 0.00%, 03/11/2022 ¹	14.958	0,37
Frankreich - Gesamt			425.908	10,47
Deutschland (30. September 2021: 5,81 %)				
100.000.000	USD	DZ Bank AG, 3.05%, 03/10/2022 ¹	99.975	2,46
15.000.000	USD	DZ Bank AG, 3.52%, 30/01/2023 ¹	14.804	0,37
20.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.75%, 01/11/2022 ¹	19.955	0,49
26.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.10%, 03/11/2022 ¹	25.937	0,64
16.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.15%, 03/01/2023 ¹	15.860	0,39
10.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.75%, 04/01/2023 ¹	9.911	0,24
Deutschland - Gesamt			186.442	4,59
Hongkong (30. September 2021: 1,88 %)				
18.000.000	USD	DBS Bank (Hong Kong) Ltd., 2.95%, 28/10/2022 ¹	17.958	0,44
23.500.000	USD	DBS Bank (Hong Kong) Ltd., 2.06%, 31/10/2022 ¹	23.439	0,58
Hongkong - Gesamt			41.397	1,02
Irland (30. September 2021: 0,13 %)				
5.000.000	USD	Matchpoint Finance plc, 3.25%, 26/10/2022 ¹	4.989	0,12
Irland - Gesamt			4.989	0,12
Japan (30. September 2021: 0,45 %)				
			-	-
Luxemburg (30. September 2021: 1,01 %)				
			-	-
Niederlande (30. September 2021: 2,63 %)				
50.000.000	USD	BNG Bank NV, 3.09%, 07/10/2022 ¹	49.971	1,23
50.000.000	USD	BNG Bank NV, 3.09%, 26/10/2022 ¹	49.888	1,23
Niederlande - Gesamt			99.859	2,46
Norwegen (30. September 2021: 0,87 %)				
15.000.000	USD	DNB Bank ASA, 0.34%, 19/10/2022 ¹	14.976	0,37
21.000.000	USD	DNB Bank ASA, 3.46%, 28/03/2023	21.020	0,52
Norwegen - Gesamt			35.996	0,89
Singapur (30. September 2021: 1,01 %)				
25.000.000	USD	United Overseas Bank Ltd., 3.17%, 27/10/2022	25.001	0,61
Singapur - Gesamt			25.001	0,61
Südkorea (30. September 2021: 0,25 %)				
			-	-
Schweden (30. September 2021: 2,42 %)				
21.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.39%, 21/11/2022	21.005	0,52
10.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 0.34%, 01/11/2022 ¹	9.972	0,24

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Schweden (Fortsetzung)				
9.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 3.66%, 13/07/2023	9.018	0,22
		Schweden - Gesamt	39.995	0,98
Schweiz (30. September 2021: 0,44 %)				
10.000.000	USD	UBS AG, 3.26%, 08/12/2022	10.001	0,25
15.000.000	USD	UBS AG, 3.31%, 03/01/2023	15.000	0,37
17.000.000	USD	UBS AG, 3.50%, 25/05/2023	17.005	0,42
5.000.000	USD	UBS AG, 3.61%, 26/09/2023	5.000	0,12
		Schweiz - Gesamt	47.006	1,16
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 4,71 %)				
60.000.000	USD	Barclays Bank plc, 3.11%, 03/10/2022 ¹	59.985	1,47
30.000.000	USD	Barclays Bank plc, 2.94%, 24/05/2023 ¹	29.178	0,72
15.000.000	USD	HSBC Bank plc, 3.58%, 06/06/2023	15.002	0,37
28.500.000	USD	Lloyds Bank plc, 3.07%, 01/11/2022 ¹	28.421	0,70
35.000.000	USD	NTT Finance UK Ltd., 2.95%, 05/10/2022 ¹	34.984	0,86
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	167.570	4,12
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 4,00 %)				
30.355.000	USD	HAT Holdings I LLC, 3.02%, 08/11/2022 ¹	30.244	0,74
20.000.000	USD	Lime Funding LLC, 3.12%, 12/10/2022 ¹	19.979	0,49
		Vereinigte Staaten - Gesamt	50.223	1,23
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			1.492.172	36,70
Termineinlagen (30. September 2021: 10,21 %)				
Kanada (30. September 2021: 5,03 %)				
50.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 3.03%, 03/10/2022	50.000	1,23
120.709.000	USD	Royal Bank of Canada, 3.07%, 03/10/2022	120.709	2,97
		Kanada - Gesamt	170.709	4,20
Frankreich (30. September 2021: 0,10 %)				
16.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 3.06%, 03/10/2022	16.000	0,40
		Frankreich - Gesamt	16.000	0,40
Japan (30. September 2021: 0,80 %)				
150.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 3.07%, 03/10/2022	150.000	3,69
		Japan - Gesamt	150.000	3,69
Schweden (30. September 2021: 4,28 %)				
148.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.07%, 03/10/2022	148.000	3,64
20.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.00%, 03/10/2022	20.000	0,49
		Schweden - Gesamt	168.000	4,13
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			504.709	12,42

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts		
ANLEIHEN						
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 2,05 %)						
		Kanada (30. September 2021: 0,37 %)	-	-		
		Luxemburg (30. September 2021: 0,25 %)	-	-		
		Niederlande (30. September 2021: 0,88 %)	-	-		
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,55 %)				
15.000.000	USD	Bank of America NA, 2.01%, 03/11/2022	14.985	0,37		
8.677.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 3.26%, 14/12/2022	8.676	0,21		
		Vereinigte Staaten - Gesamt	23.661	0,58		
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			23.661	0,58		
Supranationale Wertpapiere (30. September 2021: 0,25 %)						
Anlagen in supranationalen Wertpapieren - Gesamt			-	-		
Anlagen in Anleihen - Gesamt			23.661	0,58		
Bestand	Währung	Kontrahent	Zins- sätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (30. September 2021: 11,88 %)						
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 11,88 %)						
20.000.000	USD	BNP Paribas SA	2,96 %	03.10.2022	20.000	0,49
403.000.000	USD	BofA Securities, Inc.	3,05 %	03.10.2022	403.000	9,91
200.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	3,05 %	03.10.2022	200.000	4,92
300.000.000	USD	J.P. Morgan Securities LLC	3,05 %	03.10.2022	300.000	7,38
		Vereinigte Staaten - Gesamt			923.000	22,70
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					923.000	22,70
					Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					4.045.079	99,49
Zahlungsmittel					140.109	3,45
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(119.314)	(2,94)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					4.065.874	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamt- vermögens
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						22,59
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)						73,95
Sonstige Vermögenswerte						3,46
Gesamtvermögen						100,00

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

²Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 938.782.000 USD.

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (30. September 2021: 29,78 %)				
Australien (30. September 2021: 1,82 %)			-	-
Belgien (30. September 2021: 0,90 %)				
73.000.000	USD	Euroclear Bank SA, 3.30%, 03/11/2022 ¹	72.793	0,11
Belgien - Gesamt			72.793	0,11
Kanada (30. September 2021: 6,23 %)				
250.000.000	USD	Bank of Montreal, FRN, 3.46%, 05/05/2023	250.000	0,39
154.000.000	USD	Bank of Montreal, FRN, 3.61%, 03/07/2023	154.000	0,24
280.000.000	USD	Bank of Montreal, 3.13%, 07/10/2022 ¹	279.902	0,44
278.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.36%, 12/12/2022	278.000	0,44
105.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.47%, 16/03/2023	105.000	0,16
229.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.46%, 28/03/2023	229.000	0,36
130.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.58%, 10/04/2023	130.000	0,20
154.500.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.46%, 05/05/2023	154.500	0,24
141.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.54%, 12/05/2023	141.000	0,22
232.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.36%, 14/11/2022	232.000	0,36
140.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.26%, 06/01/2023	140.000	0,22
251.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.47%, 15/03/2023	251.000	0,39
276.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.46%, 08/05/2023	276.000	0,43
250.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.61%, 03/07/2023	250.000	0,39
97.600.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.71%, 21/07/2023	97.600	0,15
190.000.000	USD	Royal Bank of Canada, FRN, 3.61%, 03/07/2023	190.000	0,30
184.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 4.00%, 13/07/2023	184.000	0,29
210.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 4.09%, 25/08/2023	210.000	0,33
200.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.02%, 02/11/2022 ¹	199.667	0,31
232.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.36%, 10/11/2022	232.000	0,36
147.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.49%, 09/03/2023	147.000	0,23
170.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.70%, 01/05/2023	170.000	0,27
174.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.80%, 08/05/2023	174.000	0,27
250.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.53%, 02/06/2023	250.000	0,39
230.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.90%, 06/06/2023	230.000	0,36
185.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 4.13%, 24/08/2023 ¹	178.379	0,28
128.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 4.12%, 28/08/2023	128.000	0,20
140.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 4.35%, 13/09/2023	140.000	0,22
Kanada - Gesamt			5.401.048	8,44
Finnland (30. September 2021: 0,00 %)				
50.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.17%, 27/10/2022	50.000	0,08
139.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.17%, 28/10/2022	139.000	0,22
186.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.17%, 01/11/2022	186.000	0,29
40.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.18%, 15/11/2022	40.000	0,06
60.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.36%, 23/11/2022	59.999	0,09
100.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.40%, 07/12/2022	100.000	0,16
100.000.000	USD	Nordea Bank Abp, FRN, 3.54%, 02/03/2023	100.000	0,16
Finnland - Gesamt			674.999	1,06
Frankreich (30. September 2021: 1,81 %)				
238.000.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.93%, 09/02/2023 ¹	234.708	0,37
27.000.000	USD	BNP Paribas SA, 4.12%, 06/09/2023	27.000	0,04
187.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 3.55%, 06/03/2023	187.000	0,29
180.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN, 3.46%, 17/03/2023	180.000	0,28
189.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 3.05%, 28/11/2022	189.000	0,29
245.000.000	USD	Credit Agricole SA, 3.88%, 02/02/2023 ¹	241.828	0,38
95.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 3.52%, 13/01/2023 ¹	94.066	0,15
43.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 4.70%, 20/09/2023	43.000	0,07
223.000.000	USD	Natixis SA, FRN, 3.24%, 07/02/2023	223.000	0,35
Frankreich - Gesamt			1.419.602	2,22

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Japan (30. September 2021: 7,79 %)				
155.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., FRN, 3.30%, 13/10/2022	155.000	0,24
150.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 3.30%, 27/10/2022 ¹	149.671	0,23
200.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 3.32%, 20/10/2022	200.000	0,31
285.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 3.23%, 03/01/2023	285.000	0,45
250.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 3.53%, 09/01/2023	250.000	0,39
250.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 3.48%, 17/03/2023	250.000	0,39
150.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 2.99%, 02/11/2022 ¹	149.629	0,23
235.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., 3.34%, 06/01/2023 ¹	232.962	0,36
150.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., FRN, 3.40%, 07/11/2022	150.000	0,23
100.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., FRN, 3.40%, 10/11/2022	100.000	0,16
117.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., FRN, 3.26%, 23/01/2023	117.000	0,18
221.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., FRN, 3.26%, 24/01/2023	221.000	0,35
165.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 0.32%, 24/10/2022	165.000	0,26
230.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., 0.40%, 28/11/2022	230.000	0,36
500.000.000	USD	Norinchukin Bank (The), 3.08%, 01/11/2022	500.000	0,78
136.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 3.29%, 12/10/2022	136.000	0,21
400.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 3.36%, 26/10/2022	400.000	0,63
300.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 3.46%, 09/01/2023	300.000	0,47
50.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 3.58%, 24/01/2023	50.000	0,08
175.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 3.30%, 13/10/2022	175.000	0,27
100.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 3.56%, 24/01/2023	100.000	0,16
100.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 3.58%, 31/01/2023	100.000	0,16
300.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.05%, 03/10/2022	300.000	0,47
330.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.04%, 07/10/2022	330.000	0,52
140.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.30%, 21/10/2022 ¹	139.769	0,22
500.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.09%, 26/10/2022	500.000	0,78
339.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 3.09%, 27/10/2022	339.000	0,53
Japan - Gesamt			6.025.031	9,42
Niederlande (30. September 2021: 3,06 %)				
232.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 3.14%, 24/10/2022	232.000	0,36
230.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 3.15%, 08/11/2022	230.000	0,36
50.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 3.38%, 12/06/2023	50.000	0,08
275.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, 2.03%, 03/11/2022 ¹	274.524	0,43
Niederlande - Gesamt			786.524	1,23
Norwegen (30. September 2021: 0,00 %)				
173.000.000	USD	DNB Bank ASA, 4.00%, 01/06/2023 ¹	168.504	0,26
Norwegen - Gesamt			168.504	0,26
Singapur (30. September 2021: 1,34 %)				
290.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 3.50%, 13/03/2023	290.000	0,45
Singapur - Gesamt			290.000	0,45
Südkorea (30. September 2021: 0,02 %)				
			-	-
Schweden (30. September 2021: 0,40 %)				
240.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.47%, 10/03/2023	240.000	0,38
265.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.49%, 28/03/2023	265.000	0,41
296.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.64%, 03/07/2023	296.000	0,46
Schweden - Gesamt			801.000	1,25
Schweiz (30. September 2021: 1,71 %)				
381.000.000	USD	Credit Suisse AG, FRN, 3.31%, 15/11/2022	381.000	0,59
185.000.000	USD	Credit Suisse AG, 0.38%, 01/11/2022	185.000	0,29
Schweiz - Gesamt			566.000	0,88

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 4,50 %)				
186.000.000	USD	Barclays Bank plc, FRN, 3.28%, 15/02/2023	186.000	0,29
150.000.000	USD	Barclays Bank plc, FRN, 3.53%, 13/03/2023	150.000	0,23
180.000.000	USD	Barclays Bank plc, FRN, 3.60%, 05/04/2023	180.000	0,28
210.000.000	USD	Barclays Bank plc, 2.05%, 31/10/2022 ¹	209.669	0,33
143.750.000	USD	Barclays Bank plc, 2.98%, 01/06/2023	143.750	0,23
85.000.000	USD	Barclays Bank plc, 4.02%, 21/07/2023	85.000	0,13
88.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 0.46%, 02/11/2022 ¹	87.966	0,14
85.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 0.52%, 15/11/2022 ¹	84.948	0,13
102.200.000	USD	Lloyds Bank Corporate Markets plc, FRN, 3.25%, 24/01/2023	102.200	0,16
107.000.000	USD	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.40%, 01/12/2022	107.000	0,17
250.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 3.36%, 01/11/2022	250.000	0,39
70.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 3.57%, 31/01/2023	70.000	0,11
150.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 3.56%, 01/03/2023	150.000	0,23
186.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 3.26%, 13/03/2023	186.000	0,29
275.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 3.25%, 02/11/2022 ¹	274.258	0,43
Vereinigtes Königreich - Gesamt			2.266.791	3,54
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,20 %)				
188.000.000	USD	Citibank NA, FRN, 3.33%, 03/01/2023	188.000	0,30
185.000.000	USD	Citibank NA, 3.77%, 01/05/2023	185.000	0,29
230.000.000	USD	Citibank NA, 3.82%, 03/07/2023	230.000	0,36
200.000.000	USD	Citibank NA, 3.92%, 27/07/2023	200.000	0,31
194.000.000	USD	Citibank NA, 4.06%, 01/08/2023	194.000	0,30
72.000.000	USD	Citibank NA, 4.16%, 25/08/2023	72.000	0,11
100.000.000	USD	Citibank NA, 4.16%, 01/09/2023	100.000	0,16
37.000.000	USD	Citibank NA, 5.00%, 21/09/2023	37.000	0,06
Vereinigte Staaten - Gesamt			1.206.000	1,89
Anlagen in Einlagenzertifikaten - Gesamt			19.678.292	30,75
Commercial Papers (30. September 2021: 42,42 %)				
Australien (30. September 2021: 2,25 %)				
100.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 3.29%, 13/10/2022	100.000	0,16
40.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 0.27%, 14/10/2022 ¹	39.997	0,06
50.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 0.27%, 17/10/2022 ¹	49.995	0,08
88.000.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 0.27%, 20/10/2022 ¹	87.989	0,14
50.000.000	USD	Export Finance & Insurance Corp., 3.00%, 17/10/2022 ¹	49.942	0,08
140.000.000	USD	Export Finance & Insurance Corp., 2.80%, 01/11/2022 ¹	139.686	0,22
120.000.000	USD	Macquarie Bank Ltd., 3.33%, 10/01/2023	120.000	0,19
100.000.000	USD	Macquarie Bank Ltd., 3.48%, 18/01/2023	100.000	0,15
126.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., 3.46%, 14/03/2023	126.000	0,20
193.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., 3.36%, 12/05/2023	193.000	0,30
81.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 0.27%, 14/10/2022 ¹	80.993	0,13
119.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 3.38%, 20/12/2022	119.000	0,18
160.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 3.39%, 06/01/2023	160.000	0,25
115.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 3.41%, 28/03/2023	115.000	0,18
200.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 3.36%, 12/05/2023	200.000	0,31
142.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 4.24%, 30/08/2023 ¹	136.686	0,21
Australien - Gesamt			1.818.288	2,84
Österreich (30. September 2021: 1,01 %)				
280.000.000	USD	Erste Group Bank AG, 3.20%, 06/10/2022 ¹	279.925	0,44
45.000.000	USD	Oesterreichische Kontrollbank AG, 3.15%, 27/10/2022 ¹	44.906	0,07
Österreich - Gesamt			324.831	0,51

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Belgien (30. September 2021: 2,96 %)				
624.000.000	USD	Kingdom of Belgium, 3.06%, 07/10/2022 ¹	623.788	0,98
187.000.000	USD	Kingdom of Belgium, 3.10%, 11/10/2022 ¹	186.871	0,29
295.000.000	USD	Kingdom of Belgium, 2.97%, 13/10/2022 ¹	294.757	0,46
300.000.000	USD	Kingdom of Belgium, 3.15%, 17/10/2022 ¹	299.634	0,47
		Belgien - Gesamt	1.405.050	2,20
Kanada (30. September 2021: 2,82 %)				
150.000.000	USD	Bank of Montreal, 3.26%, 13/01/2023	150.000	0,23
223.000.000	USD	Bank of Montreal, 3.23%, 13/02/2023	223.000	0,35
174.000.000	USD	Bank of Montreal, 2.80%, 12/05/2023	174.000	0,27
185.200.000	USD	Bank of Montreal, 3.51%, 06/06/2023	185.200	0,29
141.000.000	USD	Bank of Montreal, 4.01%, 12/07/2023 ¹	136.748	0,21
172.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), 3.47%, 03/01/2023	172.000	0,27
300.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), 3.52%, 19/05/2023	300.000	0,47
29.500.000	USD	CDP Financial, Inc., 4.19%, 21/08/2023 ¹	28.439	0,04
78.000.000	USD	Federation des caisses Desjardins du Quebec (The), 3.07%, 11/10/2022 ¹	77.947	0,12
235.000.000	USD	Federation des caisses Desjardins du Quebec (The), 3.41%, 23/02/2023	235.000	0,37
260.000.000	USD	National Bank of Canada, 3.36%, 10/11/2022	260.000	0,41
45.000.000	USD	PSP Capital, Inc., 4.01%, 16/08/2023 ¹	43.474	0,07
230.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 3.41%, 03/01/2023	230.000	0,36
197.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 3.49%, 04/01/2023	197.000	0,31
175.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 3.48%, 31/03/2023	175.000	0,27
		Kanada - Gesamt	2.587.808	4,04
Cayman-Inseln (30. September 2021: 0,36 %)				
198.000.000	USD	Alpine Securitization Ltd., 3.38%, 04/11/2022	198.000	0,31
40.000.000	USD	Alpine Securitization Ltd., 3.51%, 21/02/2023	40.000	0,06
35.000.000	USD	Alpine Securitization Ltd., 3.51%, 21/02/2023	35.000	0,06
		Cayman-Inseln - Gesamt	273.000	0,43
Dänemark (30. September 2021: 0,99 %)				
299.000.000	USD	Jyske Bank A/S, 3.20%, 17/10/2022 ¹	298.629	0,47
		Dänemark - Gesamt	298.629	0,47
Finnland (30. September 2021: 1,68 %)				
100.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 3.12%, 07/10/2022 ¹	99.965	0,16
95.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 3.30%, 24/10/2022 ¹	94.818	0,15
100.000.000	USD	Kuntarahoitus OYJ, 3.21%, 07/11/2022 ¹	99.689	0,16
80.000.000	USD	Nordea Bank Abp, 0.31%, 21/10/2022 ¹	79.988	0,12
		Finnland - Gesamt	374.460	0,59
Frankreich (30. September 2021: 11,49 %)				
298.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 3.16%, 04/10/2022 ¹	297.974	0,47
230.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 3.05%, 02/11/2022 ¹	229.418	0,36
125.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 3.08%, 10/11/2022 ¹	124.596	0,19
232.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 3.75%, 03/02/2023 ¹	229.071	0,36
215.000.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.21%, 09/01/2023 ¹	213.157	0,33
270.000.000	USD	BNP Paribas SA, 3.36%, 24/10/2022	270.000	0,42
186.000.000	USD	BNP Paribas SA, 3.36%, 04/11/2022	186.000	0,29
150.000.000	USD	BPCE SA, 3.56%, 03/03/2023	150.000	0,23
190.000.000	USD	BPCE SA, 3.41%, 12/05/2023	190.000	0,30
200.000.000	USD	BPCE SA, 4.25%, 01/09/2023 ¹	192.461	0,30
200.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 3.09%, 03/10/2022 ¹	200.000	0,31
200.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 0.00%, 04/10/2022 ¹	199.983	0,31
315.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 3.89%, 06/01/2023 ¹	311.806	0,49
425.000.000	USD	Caisse des depots et consignations, 3.11%, 03/11/2022 ¹	423.865	0,66
593.000.000	USD	La Banque Postale SA, 3.05%, 03/10/2022 ¹	593.000	0,93

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
593.000.000	USD	La Banque Postale SA, 0.00%, 04/10/2022 ¹	592.950	0,93
105.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 2.70%, 03/10/2022 ¹	105.000	0,16
82.250.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 3.14%, 03/10/2022 ¹	82.250	0,13
88.200.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 04/10/2022 ¹	88.192	0,14
125.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 3.27%, 31/10/2022 ¹	124.683	0,20
105.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 02/11/2022 ¹	104.715	0,16
60.000.000	USD	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 3.20%, 07/11/2022 ¹	59.814	0,09
110.000.000	USD	Satellite, 2.70%, 03/10/2022 ¹	110.000	0,17
55.000.000	USD	Satellite, 3.25%, 19/10/2022 ¹	54.921	0,09
110.000.000	USD	Satellite, 0.00%, 02/11/2022 ¹	109.703	0,17
Frankreich - Gesamt			5.243.559	8,19
Deutschland (30. September 2021: 3,81 %)				
483.000.000	USD	DZ Bank AG, 3.05%, 03/10/2022 ¹	483.000	0,75
209.000.000	USD	DZ Bank AG, 3.52%, 30/01/2023 ¹	206.612	0,32
295.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.09%, 01/11/2022 ¹	294.268	0,46
215.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.75%, 01/11/2022 ¹	214.527	0,34
409.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.10%, 03/11/2022 ¹	407.912	0,64
220.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.15%, 03/01/2023 ¹	218.252	0,34
228.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.75%, 04/01/2023 ¹	225.816	0,35
193.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.50%, 03/02/2023 ¹	190.725	0,30
Deutschland - Gesamt			2.241.112	3,50
Hongkong (30. September 2021: 1,76 %)				
175.000.000	USD	DBS Bank (Hong Kong) Ltd., 2.95%, 28/10/2022 ¹	174.644	0,27
250.000.000	USD	DBS Bank (Hong Kong) Ltd., 2.06%, 31/10/2022 ¹	249.604	0,39
180.000.000	USD	DBS Bank (Hong Kong) Ltd., 2.95%, 31/10/2022 ¹	179.590	0,28
Hongkong - Gesamt			603.838	0,94
Irland (30. September 2021: 0,17 %)				
70.000.000	USD	Matchpoint Finance plc, 3.25%, 26/10/2022 ¹	69.855	0,11
Irland - Gesamt			69.855	0,11
Japan (30. September 2021: 0,18 %)				
			-	-
Luxemburg (30. September 2021: 0,88 %)				
			-	-
Niederlande (30. September 2021: 2,62 %)				
700.000.000	USD	BNG Bank NV, 3.09%, 26/10/2022 ¹	698.622	1,09
150.000.000	USD	BNG Bank NV, 3.10%, 03/11/2022 ¹	149.601	0,24
Niederlande - Gesamt			848.223	1,33
Norwegen (30. September 2021: 0,54 %)				
229.000.000	USD	DNB Bank ASA, 3.46%, 28/03/2023	229.000	0,36
50.000.000	USD	DNB Bank ASA, 3.45%, 31/05/2023	50.000	0,08
Norwegen - Gesamt			279.000	0,44
Singapur (30. September 2021: 0,99 %)				
50.000.000	USD	DBS Bank Ltd., 2.77%, 19/10/2022 ¹	49.939	0,08
65.900.000	USD	DBS Bank Ltd., 3.07%, 01/11/2022 ¹	65.737	0,10
182.500.000	USD	United Overseas Bank Ltd., 3.17%, 27/10/2022	182.500	0,29
200.000.000	USD	United Overseas Bank Ltd., 3.18%, 04/11/2022	200.000	0,31
161.000.000	USD	United Overseas Bank Ltd., 3.18%, 07/11/2022	161.000	0,25
150.000.000	USD	United Overseas Bank Ltd., 3.43%, 13/02/2023	150.000	0,24

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Singapur (Fortsetzung)				
85.000.000	USD	United Overseas Bank Ltd., 3.35%, 13/04/2023	85.000	0,13
		Singapur - Gesamt	894.176	1,40
Supranational (30. September 2021: 0,45 %)				
98.000.000	USD	Eurofima, 2.82%, 27/10/2022 ¹	97.817	0,15
		Supranational - Gesamt	97.817	0,15
Schweden (30. September 2021: 1,56 %)				
200.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 3.32%, 27/03/2023	199.969	0,31
141.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 3.66%, 13/07/2023	141.000	0,22
90.000.000	USD	Swedbank AB, 3.36%, 29/11/2022	90.000	0,14
150.000.000	USD	Swedbank AB, 3.55%, 02/03/2023	150.000	0,24
		Schweden - Gesamt	580.969	0,91
Schweiz (30. September 2021: 1,68 %)				
200.000.000	USD	UBS AG, 3.26%, 08/12/2022	200.000	0,31
100.000.000	USD	UBS AG, 3.31%, 03/01/2023	100.000	0,16
100.000.000	USD	UBS AG, 3.61%, 26/09/2023	100.000	0,15
		Schweiz - Gesamt	400.000	0,62
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 2,85 %)				
92.000.000	USD	Barclays Bank plc, 3.11%, 03/10/2022 ¹	92.000	0,14
130.000.000	USD	Barclays Bank plc, 2.94%, 24/05/2023 ¹	127.598	0,20
137.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 3.24%, 28/12/2022	137.000	0,21
150.000.000	USD	HSBC Bank plc, 3.58%, 06/06/2023	150.000	0,24
467.000.000	USD	Lloyds Bank plc, 3.07%, 01/11/2022 ¹	465.850	0,73
104.000.000	USD	NTT Finance UK Ltd., 2.95%, 05/10/2022 ¹	103.983	0,16
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	1.076.431	1,68
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 1,37 %)				
250.000.000	USD	Crown Point Capital Co. LLC, 0.30%, 05/10/2022	250.000	0,39
295.000.000	USD	Crown Point Capital Co. LLC, 3.50%, 06/12/2022	295.000	0,46
198.400.000	USD	GTA Funding LLC, 3.06%, 03/10/2022 ¹	198.400	0,31
398.447.000	USD	Liberty Street Funding LLC, 3.06%, 03/10/2022 ¹	398.447	0,62
300.000.000	USD	Qualcomm, Inc., 3.11%, 04/10/2022 ¹	299.974	0,47
100.000.000	USD	STE TransCore Holdings, Inc., 3.13%, 01/11/2022 ¹	99.749	0,16
150.000.000	USD	STE TransCore Holdings, Inc., 3.18%, 02/11/2022 ¹	149.604	0,23
		Vereinigte Staaten - Gesamt	1.691.174	2,64
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			21.108.220	32,99
Termineinlagen (30. September 2021: 17,17 %)				
Australien (30. September 2021: 0,86 %)				
600.000.000	USD	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 3.07%, 03/10/2022	600.000	0,94
		Australien - Gesamt	600.000	0,94
Kanada (30. September 2021: 3,49 %)				
520.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 3.03%, 03/10/2022	520.000	0,81
2.172.360.000	USD	Royal Bank of Canada, 3.07%, 03/10/2022	2.172.360	3,40
		Kanada - Gesamt	2.692.360	4,21

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Termineinlagen (Fortsetzung)				
		Finnland (30. September 2021: 2,59 %)	-	-
838.000.000	USD	Frankreich (30. September 2021: 0,55 %) Credit Agricole Corporate and Investment Bank, 3.06%, 03/10/2022	838.000	1,31
		Frankreich - Gesamt	838.000	1,31
850.000.000	USD	Japan (30. September 2021: 1,02 %) Mizuho Bank Ltd., 3.07%, 03/10/2022	850.000	1,33
		Japan - Gesamt	850.000	1,33
450.000.000	USD	Niederlande (30. September 2021: 0,00 %) ABN AMRO Bank NV, 3.06%, 03/10/2022	450.000	0,70
1.079.000.000	USD	Rabobank Nederland, 3.04%, 03/10/2022	1.079.000	1,69
		Niederlande - Gesamt	1.529.000	2,39
2.745.000.000	USD	Schweden (30. September 2021: 8,66 %) Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.07%, 03/10/2022	2.745.000	4,29
650.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.00%, 03/10/2022	650.000	1,01
		Schweden - Gesamt	3.395.000	5,30
Anlagen in Termineinlagen - Gesamt			9.904.360	15,48
Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 1,46 %)				
		Frankreich (30. September 2021: 0,03 %)	-	-
		Luxemburg (30. September 2021: 0,41 %)	-	-
		Niederlande (30. September 2021: 0,45 %)	-	-
100.000.000	USD	Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,57 %) Bank of America NA, 2.01%, 03/11/2022	100.000	0,16
114.726.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 3.26%, 14/12/2022	114.726	0,18
77.040.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 3.73%, 25/07/2023	77.040	0,12
		Vereinigte Staaten - Gesamt	291.766	0,46
Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt			291.766	0,46
Anlagen in Anleihen - Gesamt			291.766	0,46

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (30. September 2021: 8,13 %)						
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 8,13 %)						
2.034.000.000	USD	BNP Paribas SA	2,96 %	03.10.2022	2.034.000	3,18

BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits-termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
350.000.000	USD	BNP Paribas SA	2,94 %	03.10.2022	350.000	0,55
1.296.000.000	USD	BofA Securities, Inc.	3,05 %	03.10.2022	1.296.000	2,02
1.000.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	2,98 %	03.10.2022	1.000.000	1,56
90.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	3,05 %	03.10.2022	90.000	0,14
225.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	3,05 %	03.10.2022	225.000	0,35
150.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	2,97 %	03.10.2022	150.000	0,23
2.480.000.000	USD	Goldman Sachs & Co. LLC	3,04 %	03.10.2022	2.480.000	3,88
4.605.000.000	USD	J.P. Morgan Securities LLC	3,05 %	03.10.2022	4.605.000	7,20
Vereinigte Staaten - Gesamt					12.230.000	19,11
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					12.230.000	19,11
					Zeitwert	% des Netto-
					Tsd. USD	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					63.212.638	98,79
Zahlungsmittel					1.926.760	3,01
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(1.150.784)	(1,80)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					63.988.614	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						Gesamt-
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)						vermögens
Sonstige Vermögenswerte						19,20
Gesamtvermögen						77,71
						3,09
						100,00

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

²Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 12.414.819.000 USD.

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Bankakzepte (30. September 2021: 0,46 %)				
Kanada (30. September 2021: 0,46 %)				
30.000.000	CAD	Bank of Nova Scotia (The), 0.00%, 17/10/2022	21.805	0,50
15.000.000	CAD	Bank of Nova Scotia (The), 0.00%, 24/10/2022	10.896	0,25
45.000.000	CAD	Bank of Nova Scotia (The), 0.00%, 07/11/2022	32.636	0,75
30.000.000	CAD	FirstBank, 0.00%, 07/11/2022	21.758	0,50
15.000.000	CAD	FirstBank Group, Inc., 0.00%, 17/10/2022	10.903	0,25
20.760.000	CAD	National Bank of Canada, 0.00%, 24/10/2022	15.080	0,35
Kanada - Gesamt			113.078	2,60
Anlagen in Bankakzepten - Gesamt			113.078	2,60
Einlagenzertifikate (30. September 2021: 32,79 %)				
Australien (30. September 2021: 0,82 %)				
25.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 4.22%, 06/09/2023	24.880	0,57
Australien - Gesamt			24.880	0,57
Belgien (30. September 2021: 1,47 %)				
			-	-
Kanada (30. September 2021: 5,23 %)				
25.000.000	USD	Bank of Montreal, FRN, 3.66%, 13/07/2023	25.041	0,58
5.000.000	USD	Bank of Montreal, 0.50%, 28/11/2022	4.977	0,11
10.000.000	USD	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 3.47%, 16/03/2023	10.007	0,23
10.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.24%, 03/03/2023	9.998	0,23
15.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN, 3.51%, 31/05/2023	15.015	0,35
30.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.34%, 04/11/2022	29.919	0,69
25.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 2.23%, 02/12/2022	24.955	0,57
10.000.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.67%, 06/01/2023	9.921	0,23
10.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 0.73%, 11/01/2023	9.913	0,23
10.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 2.73%, 09/03/2023	9.936	0,23
10.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 4.00%, 13/07/2023	9.946	0,23
12.500.000	USD	Royal Bank of Canada, 4.05%, 22/08/2023	12.419	0,29
5.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 4.09%, 25/08/2023	4.969	0,11
25.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 1.85%, 24/10/2022	24.978	0,57
5.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 0.34%, 28/10/2022	4.989	0,12
14.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.00%, 02/11/2022 ¹	13.965	0,32
15.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.67%, 21/04/2023	14.848	0,34
15.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.69%, 28/04/2023	14.843	0,34
5.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 4.11%, 24/08/2023 ¹	4.794	0,11
Kanada - Gesamt			255.433	5,88
Finnland (30. September 2021: 0,23 %)				
30.000.000	USD	Nordea Bank Abp, 2.21%, 05/12/2022	29.942	0,69
Finnland - Gesamt			29.942	0,69
Frankreich (30. September 2021: 3,10 %)				
26.000.000	USD	BNP Paribas SA, 4.64%, 15/09/2023	25.980	0,60
25.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 2.53%, 13/02/2023	24.868	0,57
25.000.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 2.65%, 02/03/2023	24.848	0,57
10.000.000	USD	Natixis SA, FRN, 3.24%, 07/02/2023	10.000	0,23
Frankreich - Gesamt			85.696	1,97
Deutschland (30. September 2021: 2,37 %)				
22.500.000	USD	Bayerische Landesbank, FRN, 2.93%, 27/01/2023	22.488	0,52
10.000.000	USD	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.34%, 21/10/2022	9.984	0,23
Deutschland - Gesamt			32.472	0,75

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagenzertifikate (Fortsetzung)				
Japan (30. September 2021: 4,00 %)				
10.000.000	USD	Mizuho Bank Ltd., FRN, 3.55%, 01/02/2023	10.008	0,23
10.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., FRN, 3.26%, 23/01/2023	9.998	0,23
15.000.000	USD	MUFG Bank Ltd., FRN, 3.28%, 10/03/2023	14.995	0,34
15.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 3.23%, 19/01/2023	14.998	0,34
15.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 2.70%, 25/04/2023	14.850	0,34
25.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 3.51%, 06/01/2023	25.024	0,58
25.000.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN, 3.56%, 24/01/2023	25.026	0,58
Japan - Gesamt			114.899	2,64
Niederlande (30. September 2021: 1,83 %)				
10.000.000	USD	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA, 2.22%, 05/12/2022	9.978	0,23
30.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, 1.92%, 31/10/2022 ¹	29.917	0,69
15.000.000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, 2.01%, 03/11/2022 ¹	14.954	0,34
Niederlande - Gesamt			54.849	1,26
Norwegen (30. September 2021: 0,00 %)				
15.000.000	USD	DNB Bank ASA, 3.97%, 01/06/2023 ¹	14.562	0,33
Norwegen - Gesamt			14.562	0,33
Singapur (30. September 2021: 0,98 %)				
30.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 3.47%, 03/03/2023	30.024	0,69
Singapur - Gesamt			30.024	0,69
Südkorea (30. September 2021: 1,12 %)				
15.000.000	USD	Kookmin Bank, FRN, 3.28%, 09/02/2023	14.995	0,35
10.000.000	USD	Kookmin Bank, FRN, 3.28%, 21/02/2023	9.996	0,23
10.000.000	USD	Kookmin Bank, 2.87%, 18/05/2023 ¹	9.739	0,22
Südkorea - Gesamt			34.730	0,80
Spanien (30. September 2021: 0,49 %)				
20.000.000	USD	Banco Santander SA, FRN, 3.43%, 19/10/2022	20.003	0,46
15.000.000	USD	Banco Santander SA, FRN, 3.49%, 05/12/2022	15.005	0,35
10.000.000	USD	Banco Santander SA, FRN, 3.60%, 18/01/2023	10.007	0,23
Spanien - Gesamt			45.015	1,04
Schweden (30. September 2021: 1,47 %)				
10.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.27%, 19/12/2022	9.996	0,23
10.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.43%, 06/02/2023	10.003	0,23
10.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.23%, 24/02/2023	9.996	0,23
10.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 0.61%, 18/10/2022	9.987	0,23
Schweden - Gesamt			39.982	0,92
Schweiz (30. September 2021: 2,55 %)				
5.000.000	USD	Credit Suisse AG, FRN, 3.41%, 28/10/2022	5.001	0,11
10.000.000	USD	Credit Suisse AG, FRN, 2.80%, 01/12/2022	10.002	0,23
10.000.000	USD	Credit Suisse AG, FRN, 3.38%, 10/07/2023	9.994	0,23
10.000.000	USD	Credit Suisse AG, FRN, 3.50%, 19/01/2024	9.974	0,23
10.000.000	USD	Credit Suisse AG, 0.38%, 01/11/2022	9.976	0,23
10.000.000	USD	Credit Suisse AG, 0.42%, 10/11/2022	9.968	0,23
10.000.000	USD	UBS AG, 1.68%, 20/10/2022	9.992	0,23
Schweiz - Gesamt			64.907	1,49
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 7,13 %)				
10.000.000	USD	Barclays Bank plc, FRN, 3.28%, 03/02/2023	9.999	0,23

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Einlagezertifikate (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)				
15.000.000	USD	Barclays Bank plc, 2.03%, 31/10/2022 ¹	14.961	0,34
12.500.000	USD	Barclays Bank plc, 2.98%, 01/06/2023	12.372	0,28
20.000.000	USD	Barclays Bank plc, 4.00%, 13/07/2023	19.901	0,46
7.000.000	USD	Barclays Bank plc, 4.02%, 21/07/2023	6.964	0,16
10.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 0.51%, 15/11/2022 ¹	9.959	0,23
15.000.000	USD	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 2.81%, 11/05/2023	14.845	0,34
10.000.000	USD	Standard Chartered Bank, FRN, 3.40%, 28/07/2023	9.994	0,23
10.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 0.35%, 08/11/2022	9.969	0,23
5.000.000	USD	Standard Chartered Bank, 2.15%, 22/11/2022	4.992	0,12
Vereinigtes Königreich - Gesamt			113.956	2,62
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 0,00 %)				
15.000.000	USD	Citibank NA, 2.20%, 02/12/2022	14.964	0,35
15.000.000	USD	Citibank NA, 3.77%, 01/05/2023	14.939	0,34
Vereinigte Staaten - Gesamt			29.903	0,69
Anlagen in Einlagezertifikaten - Gesamt			971.250	22,34
Commercial Papers (30. September 2021: 51,66 %)				
Australien (30. September 2021: 2,55 %)				
5.000.000	USD	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.34%, 11/10/2022 ¹	4.995	0,12
5.000.000	USD	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.27%, 13/10/2022 ¹	4.995	0,12
25.000.000	USD	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 1.76%, 21/10/2022 ¹	24.955	0,57
18.300.000	USD	Commonwealth Bank of Australia, 0.34%, 03/11/2022 ¹	18.246	0,42
20.000.000	USD	Macquarie Bank Ltd., 4.17%, 23/08/2023 ¹	19.161	0,44
15.000.000	USD	Macquarie Bank Ltd., 4.66%, 11/09/2023 ¹	14.335	0,33
15.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., 1.89%, 11/10/2022 ¹	14.986	0,34
10.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., 0.44%, 01/11/2022 ¹	9.972	0,23
7.500.000	USD	National Australia Bank Ltd., 2.43%, 01/02/2023 ¹	7.401	0,17
6.250.000	USD	National Australia Bank Ltd., 1.42%, 24/02/2023 ¹	6.148	0,14
15.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., 3.46%, 14/03/2023	15.010	0,35
10.000.000	USD	National Australia Bank Ltd., 3.99%, 01/06/2023 ¹	9.696	0,22
9.500.000	USD	Suncorp-Metway Ltd., 1.99%, 11/10/2022 ¹	9.490	0,22
8.000.000	USD	Suncorp-Metway Ltd., 1.91%, 25/10/2022 ¹	7.981	0,18
30.000.000	USD	Suncorp-Metway Ltd., 2.02%, 31/10/2022 ¹	29.909	0,69
14.750.000	USD	Suncorp-Metway Ltd., 2.10%, 07/11/2022 ¹	14.694	0,34
20.000.000	USD	Suncorp-Metway Ltd., 3.67%, 17/01/2023 ¹	19.747	0,45
10.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 0.27%, 14/10/2022 ¹	9.988	0,23
15.000.000	USD	Westpac Banking Corp., 2.65%, 03/03/2023 ¹	14.744	0,34
Australien - Gesamt			256.453	5,90
Bermuda (30. September 2021: 1,18 %)				
8.000.000	USD	Brookfield Renewable Partners LP, 3.53%, 03/10/2022 ¹	7.998	0,18
20.330.000	USD	Brookfield Renewable Partners LP, 3.81%, 17/10/2022 ¹	20.297	0,47
4.600.000	USD	Brookfield Renewable Partners LP, 3.88%, 19/10/2022 ¹	4.591	0,11
Bermuda - Gesamt			32.886	0,76
Kanada (30. September 2021: 7,09 %)				
10.000.000	USD	Bank of Montreal, 4.23%, 29/08/2023 ¹	9.582	0,22
26.156.000	USD	Bell Canada, Inc., 3.58%, 19/10/2022 ¹	26.112	0,60
19.684.000	USD	Brookfield Infrastructure Holdings Canada, Inc., 3.66%, 25/10/2022 ¹	19.636	0,45
11.900.000	USD	CDP Financial, Inc., 3.87%, 27/06/2023 ¹	11.504	0,27
25.000.000	USD	CDP Financial, Inc., 4.00%, 10/08/2023 ¹	24.004	0,55
20.000.000	USD	CDP Financial, Inc., 4.69%, 07/09/2023 ¹	19.123	0,44
17.790.000	CAD	Enbridge Gas, Inc., 3.36%, 03/10/2022 ¹	12.946	0,30
20.000.000	CAD	Federation des caisses Desjardins du Quebec (The), 3.50%, 09/12/2022 ¹	14.470	0,33

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Kanada (Fortsetzung)				
25.000.000	CAD	Honda Canada Finance, Inc., 3.10%, 24/10/2022 ¹	18.161	0,42
22.400.000	CAD	Honda Canada Finance, Inc., 3.46%, 14/11/2022 ¹	16.242	0,37
15.000.000	CAD	Honda Canada Finance, Inc., 3.59%, 28/11/2022 ¹	10.861	0,25
18.000.000	CAD	Honda Canada, Inc., 3.09%, 27/10/2022 ¹	13.073	0,30
20.000.000	CAD	Honda Canada, Inc., 3.57%, 21/11/2022 ¹	14.491	0,33
13.825.000	CAD	Hydro One Ltd., 3.47%, 17/11/2022 ¹	10.021	0,23
50.000.000	CAD	Hydro One, Inc., 3.07%, 06/10/2022 ¹	36.379	0,84
8.000.000	CAD	Hydro One, Inc., 3.19%, 20/10/2022 ¹	5.814	0,13
14.000.000	CAD	Hydro One, Inc., 3.14%, 03/11/2022 ¹	10.161	0,23
24.647.000	CAD	Hydro One, Inc., 3.59%, 08/12/2022 ¹	17.933	0,41
20.000.000	USD	National Bank of Canada, 2.51%, 11/10/2022 ¹	19.981	0,46
30.000.000	USD	National Bank of Canada, 0.34%, 31/10/2022 ¹	29.919	0,69
10.000.000	USD	Nutrien Ltd., 3.75%, 15/11/2022 ¹	9.954	0,23
25.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 0.30%, 21/10/2022 ¹	24.955	0,58
15.000.000	USD	Royal Bank of Canada, 2.36%, 26/01/2023 ¹	14.813	0,34
10.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank (The), 2.60%, 01/03/2023 ¹	9.832	0,23
15.000.000	CAD	TransCanada Pipelines Ltd., 3.09%, 17/10/2022 ¹	10.903	0,25
25.000.000	CAD	TransCanada Pipelines Ltd., 3.67%, 28/11/2022 ¹	18.101	0,42
		Kanada - Gesamt	428.971	9,87
Dänemark (30. September 2021: 1,18 %)				
15.000.000	USD	Jyske Bank A/S, 4.14%, 03/02/2023 ¹	14.800	0,34
		Dänemark - Gesamt	14.800	0,34
Finnland (30. September 2021: 0,62 %)				
23.000.000	USD	Nordea Bank Abp, 0.30%, 21/10/2022 ¹	22.959	0,53
30.000.000	USD	OP Corporate Bank plc, 4.25%, 11/09/2023 ¹	28.689	0,66
		Finnland - Gesamt	51.648	1,19
Frankreich (30. September 2021: 8,04 %)				
10.000.000	USD	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 3.70%, 03/02/2023 ¹	9.871	0,23
11.000.000	USD	Antalis SA, 2.86%, 25/10/2022 ¹	10.976	0,25
15.000.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.17%, 09/01/2023 ¹	14.842	0,34
25.000.000	USD	BNP Paribas SA, 2.67%, 03/03/2023 ¹	24.552	0,56
10.000.000	USD	BPCE SA, 2.70%, 01/11/2022 ¹	9.972	0,23
25.000.000	USD	BPCE SA, 2.40%, 01/03/2023 ¹	24.569	0,57
10.000.000	USD	BPCE SA, 4.25%, 01/09/2023 ¹	9.581	0,22
10.000.000	USD	BRED Banque Populaire, 3.76%, 06/01/2023 ¹	9.889	0,23
7.750.000	USD	Credit Industriel et Commercial, 2.78%, 04/05/2023 ¹	7.544	0,17
20.000.000	USD	Engie SA, 3.12%, 25/10/2022 ¹	19.952	0,46
10.000.000	USD	Natixis SA, 2.94%, 01/11/2022 ¹	9.972	0,23
5.000.000	USD	Satellite, 2.54%, 03/10/2022 ¹	4.999	0,12
5.000.000	USD	Satellite, 2.87%, 19/10/2022 ¹	4.991	0,12
5.000.000	USD	Satellite, 2.87%, 02/11/2022 ¹	4.986	0,11
20.000.000	USD	Societe Generale SA, 0.29%, 13/10/2022 ¹	19.978	0,46
25.000.000	USD	Societe Generale SA, 2.65%, 31/10/2022 ¹	24.932	0,57
		Frankreich - Gesamt	211.606	4,87
Deutschland (30. September 2021: 1,34 %)				
18.000.000	USD	BASF SE, 1.81%, 03/10/2022 ¹	17.995	0,41
15.000.000	USD	DZ Bank AG, 3.48%, 30/01/2023 ¹	14.803	0,34
12.500.000	USD	E.On SE, 3.45%, 04/10/2022 ¹	12.495	0,29
20.000.000	USD	E.On SE, 3.63%, 26/10/2022 ¹	19.950	0,46
30.000.000	USD	E.On SE, 3.93%, 28/11/2022 ¹	29.816	0,68
10.000.000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.68%, 04/01/2023 ¹	9.911	0,23
30.000.000	USD	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 2.02%, 01/11/2022 ¹	29.917	0,69
		Deutschland - Gesamt	134.887	3,10

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Hongkong (30. September 2021: 1,27 %)				
19.000.000	USD	DBS Bank (Hong Kong) Ltd., 2.89%, 31/10/2022 ¹	18.950	0,44
14.000.000	USD	DBS Bank (Hong Kong) Ltd., 2.04%, 31/10/2022 ¹	13.964	0,32
		Hongkong - Gesamt	32.914	0,76
Irland (30. September 2021: 0,33 %)				
13.860.000	USD	Eaton Capital Unlimited Co., 3.26%, 03/10/2022 ¹	13.856	0,32
15.433.000	USD	Eaton Capital Unlimited Co., 3.26%, 05/10/2022 ¹	15.426	0,35
		Irland - Gesamt	29.282	0,67
Japan (30. September 2021: 1,46 %)				
15.000.000	USD	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp., 2.60%, 24/10/2022 ¹	14.969	0,34
11.200.000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 2.93%, 14/11/2022 ¹	11.155	0,26
		Japan - Gesamt	26.124	0,60
Neuseeland (30. September 2021: 2,41 %)				
30.000.000	USD	ASB Bank Ltd., 4.30%, 12/09/2023 ¹	28.692	0,66
		Neuseeland - Gesamt	28.692	0,66
Norwegen (30. September 2021: 0,00 %)				
25.000.000	USD	DNB Bank ASA, 0.34%, 19/10/2022 ¹	24.960	0,57
10.000.000	USD	DNB Bank ASA, 0.36%, 07/11/2022 ¹	9.967	0,23
15.000.000	USD	DNB Bank ASA, 3.60%, 28/04/2023 ¹	14.619	0,34
		Norwegen - Gesamt	49.546	1,14
Singapur (30. September 2021: 2,61 %)				
25.000.000	USD	DBS Bank Ltd., 2.04%, 01/11/2022 ¹	24.931	0,57
15.000.000	USD	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 3.40%, 03/01/2023	15.009	0,35
		Singapur - Gesamt	39.940	0,92
Südkorea (30. September 2021: 0,00 %)				
15.000.000	USD	Kookmin Bank, 2.82%, 25/04/2023 ¹	14.629	0,34
15.000.000	USD	Korea Development Bank, 4.09%, 26/05/2023 ¹	14.571	0,33
		Südkorea - Gesamt	29.200	0,67
Spanien (30. September 2021: 0,00 %)				
10.000.000	USD	Banco Santander SA, 2.32%, 06/12/2022 ¹	9.935	0,23
		Spanien - Gesamt	9.935	0,23
Schweden (30. September 2021: 2,61 %)				
10.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.87%, 24/10/2022 ¹	9.979	0,23
10.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.96%, 26/10/2022 ¹	9.978	0,23
10.000.000	USD	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 2.02%, 10/11/2022 ¹	9.965	0,23
10.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 1.36%, 14/02/2023 ¹	9.858	0,23
10.000.000	USD	Svenska Handelsbanken AB, 2.59%, 27/02/2023 ¹	9.842	0,23
20.000.000	USD	Swedbank AB, 1.83%, 17/10/2022 ¹	19.971	0,46
15.000.000	USD	Swedbank AB, 1.87%, 24/10/2022 ¹	14.969	0,34
15.000.000	USD	Swedbank AB, 1.96%, 26/10/2022 ¹	14.967	0,34
15.000.000	USD	Swedbank AB, 2.33%, 09/12/2022 ¹	14.901	0,34
		Schweden - Gesamt	114.430	2,63
Schweiz (30. September 2021: 0,00 %)				
20.000.000	USD	Credit Suisse AG, 2.28%, 01/12/2022 ¹	19.885	0,46

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Schweiz (Fortsetzung)				
30.000.000	USD	UBS AG, 3.61%, 26/09/2023	30.001	0,69
		Schweiz - Gesamt	49.886	1,15
Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 1,89 %)				
10.000.000	USD	Barclays Bank plc, 2.92%, 24/05/2023 ¹	9.725	0,22
5.000.000	USD	Goldman Sachs International Bank, 1.23%, 06/02/2023 ¹	4.930	0,11
25.000.000	USD	HSBC Bank plc, 3.58%, 06/06/2023	25.004	0,58
25.000.000	USD	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 3.87%, 15/05/2023 ¹	24.318	0,56
15.000.000	USD	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 4.06%, 31/05/2023 ¹	14.558	0,33
14.983.000	USD	National Grid plc, 2.96%, 06/10/2022 ¹	14.975	0,34
15.000.000	USD	NTT Finance UK Ltd., 2.50%, 05/10/2022 ¹	14.993	0,35
26.200.000	USD	Standard Chartered Bank, 3.50%, 27/01/2023 ¹	25.879	0,60
		Vereinigtes Königreich - Gesamt	134.382	3,09
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 17,08 %)				
47.000.000	USD	Agilent Technologies, Inc., 3.35%, 04/10/2022 ¹	46.983	1,08
5.000.000	USD	Alinghi Funding Co. LLC, 3.67%, 12/01/2023 ¹	4.945	0,11
25.000.000	USD	Alinghi Funding Co. LLC, 4.02%, 18/04/2023 ¹	24.400	0,56
37.750.000	USD	Amphenol Corp., 3.30%, 06/10/2022 ¹	37.729	0,87
11.137.000	USD	Amphenol Corp., 3.53%, 20/10/2022 ¹	11.116	0,26
15.000.000	USD	AT&T, Inc., 3.23%, 26/10/2022 ¹	14.963	0,34
8.000.000	USD	Atlantic Asset Securitization LLC, 2.87%, 19/10/2022 ¹	7.987	0,18
5.760.000	USD	Avery Dennison Corp., 3.13%, 11/10/2022 ¹	5.754	0,13
8.750.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 0.52%, 04/10/2022 ¹	8.747	0,20
25.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 0.35%, 27/10/2022 ¹	24.940	0,57
7.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 1.96%, 03/01/2023 ¹	6.930	0,16
10.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 2.70%, 01/03/2023 ¹	9.828	0,23
15.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc., 2.67%, 11/04/2023 ¹	14.657	0,34
15.000.000	USD	Crown Point Capital Co. LLC, 3.10%, 21/11/2022 ¹	14.926	0,34
7.340.000	USD	DuPont de Nemours, Inc., 3.08%, 11/10/2022 ¹	7.332	0,17
11.745.000	USD	DuPont de Nemours, Inc., 3.11%, 17/10/2022 ¹	11.726	0,27
32.200.000	USD	DuPont de Nemours, Inc., 3.51%, 28/10/2022 ¹	32.114	0,74
15.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 3.58%, 18/10/2022 ¹	14.975	0,34
15.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 0.52%, 21/10/2022 ¹	14.970	0,34
10.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 2.59%, 01/11/2022 ¹	9.969	0,23
5.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 3.63%, 03/11/2022 ¹	4.984	0,11
15.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 4.08%, 21/11/2022 ¹	14.921	0,34
15.000.000	USD	Enel Finance America LLC, 2.87%, 05/12/2022 ¹	14.894	0,34
31.822.000	USD	Fidelity National Information Services, Inc., 3.50%, 03/10/2022 ¹	31.813	0,73
34.200.000	USD	Fidelity National Information Services, Inc., 3.45%, 06/10/2022 ¹	34.181	0,79
2.000.000	USD	Fidelity National Information Services, Inc., 3.47%, 07/10/2022 ¹	1.999	0,05
30.000.000	USD	Fiserv, Inc., 3.33%, 03/10/2022 ¹	29.992	0,69
20.500.000	USD	Fiserv, Inc., 3.46%, 12/10/2022 ¹	20.477	0,47
16.563.000	USD	Fiserv, Inc., 3.51%, 13/10/2022 ¹	16.543	0,38
28.000.000	USD	Hewlett Packard Enterprise Co., 3.53%, 12/10/2022 ¹	27.969	0,64
20.000.000	USD	HSBC USA, Inc., 4.46%, 14/08/2023 ¹	19.176	0,44
15.000.000	USD	HSBC USA, Inc., 4.85%, 07/09/2023 ¹	14.330	0,33
15.000.000	USD	HSBC USA, Inc., 5.07%, 15/09/2023 ¹	14.312	0,33
40.000.000	USD	Hyundai Capital America, Inc., 3.30%, 03/10/2022 ¹	39.989	0,92
30.000.000	USD	Hyundai Capital America, Inc., 3.49%, 26/10/2022 ¹	29.924	0,69
15.000.000	USD	Hyundai Capital America, Inc., 3.51%, 28/10/2022 ¹	14.959	0,34
30.000.000	USD	J.P. Morgan Securities plc, 2.16%, 28/11/2022 ¹	29.832	0,69
20.000.000	USD	J.P. Morgan Securities plc, 2.28%, 05/12/2022 ¹	19.872	0,46
25.000.000	USD	Lime Funding LLC, 2.94%, 21/10/2022 ¹	24.955	0,57
17.685.000	USD	Mercedes-Benz Finance North America LLC, 3.39%, 26/10/2022 ¹	17.640	0,41
25.000.000	USD	Mitsubishi HC Capital America, Inc., 3.06%, 03/10/2022 ¹	24.993	0,58
4.853.000	USD	Mitsubishi HC Capital America, Inc., 3.61%, 19/10/2022 ¹	4.844	0,11
8.491.000	USD	Mitsubishi HC Capital America, Inc., 3.67%, 28/10/2022 ¹	8.467	0,20
20.000.000	USD	Nieuw Amsterdam Receivables Corp., 2.84%, 24/10/2022 ¹	19.958	0,46

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Commercial Papers (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
4.300.000	USD	Pricoa Short Term Funding LLC, 4.93%, 01/09/2023 ¹	4.120	0,09
10.000.000	USD	Pricoa Short Term Funding LLC, 5.00%, 13/09/2023 ¹	9.564	0,22
33.000.000	USD	Sherwin-Williams Co. (The), 3.47%, 18/10/2022 ¹	32.947	0,76
23.000.000	USD	Sony Capital Corp., 3.40%, 05/10/2022 ¹	22.989	0,53
60.000.000	USD	Sony Capital Corp., 3.45%, 07/10/2022 ¹	59.959	1,38
7.381.000	USD	Spire, Inc., 3.04%, 07/10/2022 ¹	7.376	0,17
10.000.000	USD	Spire, Inc., 3.34%, 13/10/2022 ¹	9.988	0,23
27.300.000	USD	Spire, Inc., 3.38%, 19/10/2022 ¹	27.250	0,63
12.908.000	USD	Spire, Inc., 3.55%, 20/10/2022 ¹	12.883	0,30
15.750.000	USD	Spire, Inc., 3.61%, 01/11/2022 ¹	15.700	0,36
17.828.000	USD	Vulcan Materials Co., 3.50%, 04/10/2022 ¹	17.821	0,41
5.815.000	USD	Vulcan Materials Co., 3.13%, 11/10/2022 ¹	5.809	0,13
17.619.000	USD	Vulcan Materials Co., 3.51%, 12/10/2022 ¹	17.598	0,41
2.717.000	USD	VW Credit, Inc., 3.51%, 21/10/2022 ¹	2.712	0,06
		Vereinigte Staaten - Gesamt	1.052.731	24,21
Anlagen in Commercial Papers - Gesamt			2.728.313	62,76
ANLEIHEN				
Schuldtitel von Unternehmen (30. September 2021: 6,59 %)				
Australien (30. September 2021: 0,46 %)				
9.200.000	USD	Macquarie Bank Ltd., 2.10%, 17/10/2022	9.193	0,21
10.000.000	USD	Macquarie Bank Ltd., FRN, 3.30%, 06/04/2023	9.971	0,23
		Australien - Gesamt	19.164	0,44
Kanada (30. September 2021: 0,00 %)				
4.000.000	USD	CPPIB Capital, Inc., 0.75%, 21/10/2022	3.994	0,09
25.000.000	CAD	Sumitomo Mitsui Banking Corp. of Canada, 0.00%, 03/10/2022	18.193	0,42
20.000.000	CAD	Sumitomo Mitsui Banking Corp. of Canada, 0.00%, 25/10/2022	14.528	0,33
25.000.000	CAD	Sumitomo Mitsui Banking Corp. of Canada, 0.00%, 26/10/2022	18.159	0,42
		Kanada - Gesamt	54.874	1,26
Frankreich (30. September 2021: 0,09 %)				
1.800.000	USD	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.13%, 21/11/2022	1.795	0,04
		Frankreich - Gesamt	1.795	0,04
Japan (30. September 2021: 0,13 %)				
			-	-
Niederlande (30. September 2021: 1,03 %)				
			-	-
Neuseeland (30. September 2021: 0,13 %)				
			-	-
Südkorea (30. September 2021: 0,46 %)				
10.000.000	USD	Kookmin Bank, FRN, 3.69%, 09/06/2023	10.000	0,23
		Südkorea - Gesamt	10.000	0,23

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schuldtitel von Unternehmen (Fortsetzung)				
		Schweden (30. September 2021: 0,34 %)	-	-
		Schweiz (30. September 2021: 0,33 %)	-	-
		Vereinigtes Königreich (30. September 2021: 0,80 %)	-	-
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 2,82 %)		
7.500.000	USD	Bank of America Corp., 3.30%, 11/01/2023	7.481	0,17
50.000.000	USD	Bank of America NA, 2.01%, 03/11/2022	49.952	1,15
13.700.000	USD	Brighthouse Financial Global Funding, FRN, 3.30%, 24/02/2023	13.677	0,31
9.565.000	USD	Florida Power & Light Co., FRN, 3.37%, 12/01/2024	9.487	0,22
16.315.000	USD	John Deere Capital Corp., FRN, 3.12%, 10/07/2023	16.242	0,37
6.152.000	USD	Mercedes-Benz Finance North America LLC, 1.75%, 10/03/2023	6.073	0,14
9.323.000	USD	Metropolitan Life Global Funding I, 1.95%, 13/01/2023	9.260	0,22
9.995.000	USD	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp., FRN, 3.39%, 07/08/2023	9.972	0,23
17.822.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 3.18%, 13/02/2023	17.798	0,41
15.000.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 3.32%, 06/04/2023	14.964	0,34
11.560.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 3.73%, 25/07/2023	11.582	0,27
15.000.000	USD	Toyota Motor Credit Corp., FRN, 3.63%, 29/12/2023	15.028	0,35
		Vereinigte Staaten - Gesamt	181.516	4,18
		Anlagen in Schuldtiteln von Unternehmen - Gesamt	267.349	6,15
Staatsanleihen (30. September 2021: 2,51 %)				
		Kanada (30. September 2021: 1,47 %)	-	-
		Vereinigte Staaten (30. September 2021: 1,04 %)	-	-
		Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt	-	-
Supranationale Wertpapiere (30. September 2021: 1,08 %)				
		Anlagen in supranationalen Wertpapieren - Gesamt	-	-
		Anlagen in Anleihen - Gesamt	267.349	6,15

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte²				
Buy USD 19,227,769; Sell CAD 25,000,000	Toronto-Dominion Bank	03.10.2022	1.034	0,02
Buy USD 13,457,038; Sell CAD 17,745,170	Citibank	03.10.2022	543	0,01
Buy USD 33,998; Sell CAD 44,830	Bank of America	03.10.2022	1	-
Buy USD 38,606,223; Sell CAD 49,674,500	State Street	06.10.2022	2.454	0,06
Buy USD 252,977; Sell CAD 325,500	Toronto-Dominion Bank	06.10.2022	16	-
Buy USD 22,759,045; Sell CAD 29,760,000	UBS	17.10.2022	1.101	0,03
Buy USD 11,573,742; Sell CAD 14,997,450	Toronto-Dominion Bank	17.10.2022	660	0,02
Buy USD 11,384,755; Sell CAD 14,880,000	ANZ	17.10.2022	556	0,01
Buy USD 183,532; Sell CAD 240,000	Bank of America	17.10.2022	9	-
Buy USD 94,580; Sell CAD 122,550	State Street	17.10.2022	5	-

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeitstermin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Devisenterminkontrakte² (Fortsetzung)				
Buy USD 6,158,194; Sell CAD 7,936,400	Toronto-Dominion Bank	20.10.2022	383	0,01
Buy USD 49,350; Sell CAD 63,600	Bank of America	20.10.2022	3	–
Buy USD 27,558,675; Sell CAD 35,481,349	Toronto-Dominion Bank	24.10.2022	1.738	0,04
Buy USD 19,427,331; Sell CAD 25,000,000	Citibank	24.10.2022	1.234	0,03
Buy USD 126,172; Sell CAD 162,551	Goldman Sachs	24.10.2022	8	–
Buy USD 90,287; Sell CAD 116,100	State Street	24.10.2022	6	–
Buy USD 15,408,591; Sell CAD 19,838,800	Toronto-Dominion Bank	25.10.2022	971	0,02
Buy USD 125,205; Sell CAD 161,200	Bank of America	25.10.2022	8	–
Buy USD 19,271,853; Sell CAD 24,798,500	State Street	26.10.2022	1.225	0,03
Buy USD 156,598; Sell CAD 201,500	Bank of America	26.10.2022	10	–
Buy USD 14,005,020; Sell CAD 18,000,000	Toronto-Dominion Bank	27.10.2022	906	0,02
Buy USD 10,809,240; Sell CAD 13,887,440	Barclays	03.11.2022	703	0,02
Buy USD 87,606; Sell CAD 112,560	Toronto-Dominion Bank	03.11.2022	6	–
Buy USD 34,125,508; Sell CAD 45,000,000	State Street	07.11.2022	1.378	0,03
Buy USD 22,872,838; Sell CAD 30,000,000	Bank of America	07.11.2022	1.041	0,02
Buy USD 16,987,269; Sell CAD 22,261,120	UBS	14.11.2022	787	0,02
Buy USD 105,974; Sell CAD 138,880	State Street	14.11.2022	5	–
Buy USD 10,449,356; Sell CAD 13,725,321	Toronto-Dominion Bank	17.11.2022	461	0,01
Buy USD 75,879; Sell CAD 99,679	Bank of America	17.11.2022	3	–
Buy USD 15,110,506; Sell CAD 19,843,400	Toronto-Dominion Bank	21.11.2022	669	0,02
Buy USD 119,251; Sell CAD 156,600	Bank of America	21.11.2022	5	–
Buy USD 19,127,251; Sell CAD 24,798,500	Citibank	28.11.2022	1.079	0,03
Buy USD 11,389,483; Sell CAD 15,000,000	Toronto-Dominion Bank	28.11.2022	473	0,01
Buy USD 155,414; Sell CAD 201,500	UBS	28.11.2022	9	–
Buy USD 18,812,461; Sell CAD 24,422,958	UBS	08.12.2022	1.036	0,02
Buy USD 172,575; Sell CAD 224,042	Toronto-Dominion Bank	08.12.2022	10	–
Buy USD 15,191,182; Sell CAD 19,815,200	Bank of America	09.12.2022	768	0,02
Buy USD 141,663; Sell CAD 184,800	UBS	09.12.2022	7	–
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2021: 0,04 %)			21.311	0,50
Anteilklasse Heritage (CHF Hedged)				
Buy USD 21,102,108; Sell CHF 20,437,483	State Street	04.10.2022	338	–
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2021: 0,00 %)			338	–
Anteilklasse Heritage (SGD Hedged)				
Buy USD 273,002; Sell SGD 380,813	State Street	04.10.2022	7	–
Nicht realisierter Gewinn - Gesamt (30. September 2021: 0,00 %)			7	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2021: 0,04 %)			21.656	0,50
Devisenterminkontrakte²				
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2021: (0,01) %)			–	–
Anteilklasse Heritage (CHF Hedged)				
Buy CHF 28,825,265; Sell USD 29,611,144	State Street	04.10.2022	(325)	(0,01)
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2021: 0,00 %)			(325)	(0,01)

BLACKROCK ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Beschreibung	Kontrahent	Fälligkeits-termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Nettoinventarwerts
Devisenterminkontrakte² (Fortsetzung)				
Anteilklasse Heritage (SGD Hedged)				
Buy SGD 17,650,675; Sell USD 12,653,702	State Street	04.10.2022	(352)	(0,01)
Nicht realisierter Verlust - Gesamt (30. September 2021: 0,00 %)³			(352)	(0,01)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - Gesamt (30. September 2021: (0,01) %)			(677)	(0,02)
			Zeitwert Tsd. USD	% des Nettoinventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			4.101.646	94,35
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt			(677)	(0,02)
Zahlungsmittel			42.721	0,98
Zahlungsmitteläquivalente				
Bestand	Währung	Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW) (30. September 2021: 4,95 %)		
192.958.340	USD	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis) ⁴	192.958	4,44
Zahlungsmitteläquivalente - Gesamt			192.958	4,44
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			10.586	0,25
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert			4.347.234	100,00
				% des Gesamtvermögens
Analyse des Gesamtvermögens				
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind				0,26
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				5,86
Sonstige übertragbare Wertpapiere im Sinne von Vorschrift 68(1)(a), (b) und (c)				87,29
Investmentfonds (CIS)				4,42
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)				0,50
Sonstige Vermögenswerte				1,67
Gesamtvermögen				100,00

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

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.

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

⁴Dem Fonds nahestehende Partei.

Derivative Finanzinstrumente	Basisengagement TSD. USD
Devisenterminkontrakte	437.001

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Anlagen	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
ANLEIHEN				
Staatsanleihen (30. September 2021: 34,78 %)				
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 34,78 %)				
229.295.000	USD	US Cash Management Bill, 2.81%, 13/12/2022 ¹	228.038	1,06
350.000.000	USD	US Cash Management Bill, 3.00%, 27/12/2022 ¹	347.546	1,62
127.635.000	USD	US Treasury, 2.00%, 30/11/2022	127.856	0,59
43.185.000	USD	US Treasury, 1.63%, 15/12/2022	43.208	0,20
31.465.000	USD	US Treasury, 2.13%, 31/12/2022	31.551	0,15
88.980.000	USD	US Treasury, 0.13%, 31/01/2023	88.527	0,41
15.470.000	USD	US Treasury, 1.50%, 28/02/2023	15.490	0,07
18.880.000	USD	US Treasury, 1.50%, 31/03/2023	18.914	0,09
40.550.000	USD	US Treasury, 2.50%, 31/03/2023	40.816	0,19
25.350.000	USD	US Treasury, 0.13%, 30/04/2023	25.064	0,12
48.145.000	USD	US Treasury, 1.75%, 15/05/2023	48.017	0,22
153.307.600	USD	US Treasury Bill, 1.12%, 06/10/2022 ¹	153.293	0,71
273.605.000	USD	US Treasury Bill, 1.23%, 13/10/2022 ¹	273.512	1,27
206.260.000	USD	US Treasury Bill, 2.50%, 18/10/2022 ¹	206.046	0,96
375.510.000	USD	US Treasury Bill, 2.49%, 20/10/2022 ¹	375.072	1,74
6.605.000	USD	US Treasury Bill, 2.62%, 25/10/2022 ¹	6.594	0,03
369.445.200	USD	US Treasury Bill, 0.40%, 03/11/2022 ¹	369.319	1,72
401.000.000	USD	US Treasury Bill, 2.80%, 08/11/2022 ¹	399.883	1,86
2.200.000.000	USD	US Treasury Bill, 2.93%, 15/11/2022 ¹	2.192.325	10,19
500.000.000	USD	US Treasury Bill, 3.00%, 22/11/2022 ¹	497.924	2,31
148.235.000	USD	US Treasury Bill, 2.90%, 01/12/2022 ¹	147.535	0,69
12.740.000	USD	US Treasury Bill, 3.18%, 15/12/2022 ¹	12.659	0,06
370.625.000	USD	US Treasury Bill, 2.41%, 29/12/2022 ¹	368.491	1,71
250.000.000	USD	US Treasury Bill, 2.53%, 05/01/2023 ¹	248.368	1,15
250.000.000	USD	US Treasury Bill, 2.72%, 12/01/2023 ¹	248.117	1,15
80.895.000	USD	US Treasury Bill, 0.63%, 26/01/2023 ¹	80.732	0,38
309.250.000	USD	US Treasury Bill, 1.14%, 23/02/2023 ¹	307.862	1,43
50.000.000	USD	US Treasury Bill, 3.30%, 02/03/2023 ¹	49.323	0,23
1.161.740.000	USD	US Treasury Bill, 3.53%, 16/03/2023 ¹	1.143.402	5,31
200.000.000	USD	US Treasury Bill, 1.62%, 23/03/2023 ¹	198.490	0,92
404.385.000	USD	US Treasury Bill, 2.15%, 18/05/2023 ¹	399.030	1,85
3.000.000	USD	US Treasury Bill, 3.47%, 10/08/2023 ¹	2.913	0,01
Vereinigte Staaten - Gesamt			8.695.917	40,40
Anlagen in Staatsanleihen - Gesamt			8.695.917	40,40
Anlagen in Anleihen - Gesamt			8.695.917	40,40

Bestand	Währung	Kontrahent	Zins- sätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (30. September 2021: 66,06 %)						
Vereinigte Staaten (30. September 2021: 66,06 %)						
996.000.000	USD	Barclays Capital, Inc.	2,98 %	03.10.2022	996.000	4,63
2.300.000.000	USD	BNP Paribas SA	2,96 %	03.10.2022	2.300.000	10,69
100.000.000	USD	BNP Paribas SA	2,96 %	03.10.2022	100.000	0,46
1.050.000.000	USD	BofA Securities, Inc.	2,95 %	03.10.2022	1.050.000	4,88
109.000.000	USD	BofA Securities, Inc.	2,95 %	03.10.2022	109.000	0,51
1.150.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	2,98 %	03.10.2022	1.150.000	5,34
95.000.000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	2,98 %	03.10.2022	95.000	0,44
75.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	2,97 %	03.10.2022	75.000	0,35
40.000.000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	2,97 %	03.10.2022	40.000	0,19
1.690.000.000	USD	Credit Suisse AG	2,97 %	03.10.2022	1.690.000	7,85

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNG DER VERMÖGENSWERTE (Fortsetzung)

Zum 30. September 2022

Bestand	Währung	Kontrahent	Zinssätze	Fälligkeits- termin	Zeitwert Tsd. USD	% des Netto- inventarwerts
Umgekehrte Repogeschäfte² (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
840.416.661	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	840.417	3,90
481.004.902	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	481.005	2,23
298.602.574	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	298.603	1,39
288.602.941	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	288.603	1,34
241.272.059	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	241.272	1,12
121.833.333	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	121.833	0,57
109.310.056	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	109.310	0,51
66.666.667	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	66.667	0,31
60.313.168	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	60.313	0,28
47.078.284	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	47.078	0,22
40.137.964	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	40.138	0,19
4.761.887	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	2,98 %	03.10.2022	4.762	0,02
955.000.000	USD	Societe Generale SA	2,97 %	03.10.2022	955.000	4,44
900.000.000	USD	TD Securities (USA) LLC	2,97 %	03.10.2022	900.000	4,18
Vereinigte Staaten - Gesamt					12.060.001	56,04
Anlagen in umgekehrten Repogeschäften - Gesamt					12.060.001	56,04
					Zeitwert	% des Netto-
					Tsd. USD	inventarwerts
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet - Gesamt					20.755.918	96,44
Zahlungsmittel					859.380	3,99
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					(93.627)	(0,43)
Inhabern rückkaufbarer Anteile zuzurechnender Nettoinventarwert					21.521.671	100,00
Analyse des Gesamtvermögens						% des
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind						Gesamt-
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						vermögens
Sonstige Vermögenswerte						2,03
Gesamtvermögen						93,97
						4,00
						100,00

¹Bei den Sätzen handelt es sich um Diskontsätze oder eine Bandbreite von Diskontsätzen zum Jahresende.

²Als Sicherheiten gehaltene Wertpapiere beliefen sich auf 12.153.051.000 USD.

BLACKROCK EURO ULTRA SHORT CORE BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
2.126.282	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc T0) Shares	209.000
36.000.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 30/06/2022	36.009
35.000.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 01/08/2022	35.006
35.000.000	Enel Finance America LLC Discount Notes, 3.70%, 28/10/2022	34.279
30.000.000	Macquarie Bank Ltd., FRN, 0.95%, 20/10/2023	30.428
30.000.000	Avery Dennison Corp., 0.00%, 18/03/2022	30.004
30.000.000	RWE AG, 0.00%, 18/08/2022	29.999
30.000.000	RWE AG, 0.00%, 19/09/2022	29.987
30.000.000	RWE AG Discount Notes, 0.88%, 19/10/2022	29.975
25.000.000	Mitsubishi HC Capital UK plc, 0.00%, 26/05/2022	25.008
25.000.000	Brambles Finance plc, 0.00%, 26/07/2022	25.003
25.000.000	Barclays Bank plc, 0.96%, 05/05/2023	25.000
25.000.000	Brambles Finance plc Discount Notes, 0.34%, 26/10/2022	24.978
24.000.000	MUFG Bank Ltd., 0.00%, 01/07/2022	24.026
23.000.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 30/12/2021	23.013
25.000.000	American Electric Power Co., Inc., 0.00%, 16/05/2022	22.694
21.000.000	American Honda Finance Corp., 1.38%, 10/11/2022	21.074
21.000.000	Realty Income Corp. Discount Notes, 0.92%, 09/11/2022	20.966
20.000.000	Ancor UK Finance plc, 0.00%, 06/05/2022	20.031
20.000.000	NTT Finance UK Ltd., 0.00%, 22/04/2022	20.026

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
2.139.384	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc T0) Shares	210.267
10.000.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 30/06/2022	10.000
9.500.000	Credit Agricole SA, FRN, 0.00%, 17/01/2022	9.501
8.500.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 30/12/2021	8.501
8.000.000	Credit Suisse AG, FRN, 0.39%, 18/05/2022	8.002
5.000.000	Danaher Corp., 0.00%, 28/07/2022	5.000
4.000.000	Fisvec, 0.00%, 15/09/2022	4.000
3.000.000	JPMorgan Chase & Co., 2.75%, 24/08/2022	3.004
3.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.50%, 16/11/2022	2.999
2.000.000	Evonik Industries AG, 0.00%, 11/07/2022	2.000

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 ICS EURO GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe			Kosten
Menge	Anlagen		Tsd. EUR
12.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 27/07/2022		12.009
12.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 03/08/2022		12.004
11.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 05/01/2022		11.020
11.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 21/09/2022		11.003
11.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 14/09/2022		11.002
10.600.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 06/07/2022		10.611
10.600.000	France Treasury Bill BTFDiscount Notes, 0.19%, 05/10/2022		10.599
10.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 11/05/2022		10.508
10.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 20/07/2022		10.507
9.700.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/05/2022		9.706
9.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 27/04/2022		9.503
9.400.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 13/07/2022		9.406
8.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 06/04/2022		8.513
8.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 13/04/2022		8.013
8.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 18/05/2022		8.004
7.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 16/02/2022		7.517
7.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 21/04/2022		7.006
7.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 10/08/2022		7.002
7.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 23/02/2022		7.002
6.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 09/02/2022		6.501
6.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 01/06/2022		6.016
5.550.000	France Treasury Bill BTFDiscount Notes, 0.20%, 12/10/2022		5.549
5.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 12/01/2022		5.507
5.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 02/02/2022		5.505
5.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 10/11/2021		5.501
5.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 19/01/2022		5.008
5.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 16/03/2022		5.006
5.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 09/03/2022		5.002
4.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 26/01/2022		4.007
4.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 25/05/2022		4.003
4.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 23/03/2022		4.002
4.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 01/12/2021		4.002
4.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 04/11/2021		4.001
3.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 22/06/2022		3.501
3.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 02/03/2022		3.001
3.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 07/09/2022		3.001
3.000.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 15/06/2022		3.001
Verkäufe			Erlöse
Menge	Anlagen		Tsd. EUR
4.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 11/05/2022		4.500
1.500.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 17/11/2021		1.501
750.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 10/08/2022		750
500.000	Austria Treasury Bill, 0.00%, 25/11/2021		500

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 ICS EURO LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 12/01/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 09/03/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 02/03/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 23/02/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 16/02/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 16/03/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 02/02/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 26/01/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 19/01/2022	250.028
250.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 09/02/2022	250.028
240.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 06/04/2022	240.053
240.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 23/03/2022	240.027
225.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 25/05/2022	225.025
225.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 13/04/2022	225.025
225.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 20/04/2022	225.025
225.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 27/04/2022	225.025
225.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 04/05/2022	225.025
225.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 11/05/2022	225.025
225.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 18/05/2022	225.025
225.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 01/06/2022	225.025

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
100.000.000	Nordea Bank Abp, 0.00%, 07/12/2021	100.081
30.000.000	Zuercher Kantonalbank, 0.00%, 01/07/2022	30.014
30.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 01/07/2022	30.013
25.000.000	Nordea Bank Abp, 0.00%, 01/07/2022	25.011
20.000.000	Svenska Handelsbanken AB, 0.00%, 30/11/2021	20.013
20.000.000	Svenska Handelsbanken AB, 0.00%, 12/11/2021	20.007
20.000.000	Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 10/11/2021	20.007
5.000.000	Standard Chartered BankDiscount Notes, (0.47)%, 12/10/2022	4.999

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, so wie 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 ICS EURO LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
1.500.000.000	Kingdom of Belgium, 0.00%, 16/11/2021	1.500.149
1.500.000.000	BNG Bank NV, 0.00%, 22/09/2022	1.499.810
1.265.000.000	Kingdom of The Netherlands Discount Notes, 0.44%, 03/10/2022	1.264.814
1.064.000.000	European Union Bill, 0.00%, 07/01/2022	1.065.661
1.050.000.000	Belgium Treasury Bill, 0.00%, 13/01/2022	1.051.323
1.000.000.000	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 25/11/2021	1.000.115
1.000.000.000	Erste Group Bank AG, 0.00%, 31/01/2022	1.000.111
1.000.000.000	La Banque Postale SA Discount Notes, 0.63%, 06/10/2022	999.755
996.000.000	BNG Bank NV, 0.00%, 18/03/2022	996.116
996.000.000	BNG Bank NV, 0.00%, 11/03/2022	996.114
916.000.000	BPCE SA, 0.83%, 03/01/2023	916.000
895.000.000	Swedbank AB, 0.00%, 08/08/2022	895.983
858.600.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 06/01/2022	860.023
849.000.000	Standard Chartered Bank, 0.00%, 01/08/2022	851.356
850.000.000	Danske Bank A/S, 0.00%, 01/02/2022	851.065
846.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 07/06/2022	846.373
798.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 29/04/2022	798.392
767.000.000	Standard Chartered Bank Discount Notes, 0.72%, 01/02/2023	764.110
750.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 04/04/2022	750.184
725.000.000	BNG Bank NV, 0.00%, 14/04/2022	725.169

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
400.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 21/04/2022	400.924
400.000.000	European Union Bill, 0.00%, 08/04/2022	400.828
400.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 17/03/2022	400.676
400.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 20/01/2022	400.279
327.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.00%, 04/01/2022	327.062
315.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 19/05/2022	316.012
300.000.000	CA Consumer Finance SA, 0.00%, 05/01/2022	300.055
268.000.000	Nordea Bank Abp, 0.00%, 07/12/2021	268.218
250.000.000	Basler Kantonalbank, 0.00%, 04/01/2022	250.044
245.000.000	European Union Bill, 0.00%, 04/02/2022	245.255
245.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 31/03/2022	245.085
230.000.000	Zuercher Kantonalbank, 0.00%, 01/07/2022	230.053
225.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 01/07/2022	225.049
200.000.000	Nordea Bank Abp, 0.00%, 01/12/2021	200.164
200.000.000	Jyske Bank A/S, 0.00%, 06/12/2021	200.163
200.000.000	Belgium Treasury Bill, 0.00%, 13/01/2022	200.153
200.000.000	European Union Bill, 0.00%, 07/01/2022	200.076
200.000.000	Kommunalbanken A/S, 0.00%, 06/01/2022	200.054
200.000.000	Nordea Bank Abp, 0.00%, 01/07/2022	200.046
200.000.000	Zuercher Kantonalbank, 0.00%, 04/01/2022	200.036
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 04/01/2022	200.034
199.500.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 30/06/2022	199.539
150.000.000	Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 12/07/2022	150.054
125.000.000	BPCE SA, 0.00%, 10/03/2022	125.043
100.000.000	BPCE SA, 0.00%, 08/02/2022	100.031
100.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 06/01/2022	100.022
100.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 04/05/2022	100.018
100.000.000	BPCE SA, 0.00%, 04/01/2022	100.017
100.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 03/02/2022	100.005
100.000.000	Purple Protected Asset, FRN, (0.40)%, 30/06/2022	100.000
80.000.000	Mizuho Bank Ltd., 0.00%, 10/11/2021	80.028
70.000.000	Standard Chartered Bank, 0.00%, 05/09/2022	70.000

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 ICS EURO ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. EUR
10.579.290	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc T0) Shares	1.039.800
250.000.000	Zuercher Kantonalbank, 0.00%, 13/05/2022	250.688
230.000.000	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 0.00%, 03/06/2022	230.641
230.000.000	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 0.00%, 03/08/2022	230.164
211.000.000	Macquarie Bank Ltd., FRN, 0.95%, 20/10/2023	214.011
200.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 14/04/2022	200.264
200.000.000	Nykredit Bank A/S, 0.00%, 18/02/2022	200.095
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 21/02/2022	200.010
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 23/02/2022	200.003
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 22/02/2022	200.003
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 03/11/2021	200.003
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 04/11/2021	200.003
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 29/08/2022	200.002
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 26/08/2022	200.001
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 25/08/2022	200.001
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 01/09/2022	200.001
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 02/09/2022	200.001
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 06/09/2022	200.001
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 20/09/2022	199.996
200.000.000	La Banque Postale SA, 0.00%, 21/09/2022	199.996
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. EUR
11.831.996	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Agency (Acc T0) Shares	1.162.979
100.000.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 30/08/2022	99.976
50.000.000	Macquarie Bank Ltd., FRN, 0.20%, 03/03/2022	50.120
8.000.000	Realty Income Corp., 0.00%, 19/09/2022	7.999

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 ICS STERLING GOVERNMENT LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe			Kosten
Menge	Anlagen		Tsd. GBP
227.400.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 07/02/2022		227.393
218.164.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2022		217.917
202.453.000	UK Treasury BillDiscount Notes, 1.57%, 10/10/2022		201.760
194.216.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 31/01/2022		194.213
140.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 13/12/2021		139.999
107.750.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 14/02/2022		107.742
103.061.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 15/11/2021		103.061
94.203.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 25/10/2021		94.203
92.185.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2022		92.023
79.250.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 08/08/2022		78.908
75.000.000	UK Treasury BillDiscount Notes, 2.01%, 14/11/2022		74.627
60.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2022		59.909
60.000.000	UK Treasury BillDiscount Notes, 2.66%, 12/12/2022		59.605
50.740.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 29/11/2021		50.739
43.700.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 30/08/2022		43.684
42.500.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 06/12/2021		42.500
42.300.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 21/02/2022		42.298
40.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2022		39.982
30.103.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 15/08/2022		30.052
30.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2022		29.990
29.080.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 21/03/2022		29.070
28.500.000	UK Treasury BillDiscount Notes, 1.70%, 03/10/2022		28.401
26.144.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 12/09/2022		26.136
25.000.000	UK Treasury BillDiscount Notes, 1.97%, 07/11/2022		24.878
25.000.000	UK Treasury BillDiscount Notes, 1.40%, 31/10/2022		24.828

Verkäufe			Erlöse
Menge	Anlagen		Tsd. GBP
218.164.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2022		218.114
4.378.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2022		4.377

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 ICS STERLING LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. GBP
300.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 07/07/2022	299.868
300.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 07/07/2022	299.863
300.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 21/07/2022	299.863
300.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 21/07/2022	299.860
300.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 08/08/2022	299.815
250.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 31/01/2022	250.034
250.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 09/08/2022	249.831
200.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 22/08/2022	199.935
200.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 15/08/2022	199.935
200.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 07/09/2022	199.926
200.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 30/08/2022	199.926
200.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 16/09/2022	199.916
200.000.000	Barclays Bank UK plcDiscount Notes, 2.16%, 03/10/2022	199.916
200.000.000	Barclays Bank UK plc, 0.00%, 26/09/2022	199.907
180.000.000	Kingdom of The NetherlandsDiscount Notes, 2.25%, 03/10/2022	179.888
125.000.000	Mizuho Bank Ltd., 0.85%, 05/05/2022	125.000
110.000.000	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 2.19%, 09/11/2022	110.000
105.000.000	ING Bank NVDiscount Notes, 2.55%, 06/02/2023	103.660
100.000.000	Standard Chartered Bank, 1.25%, 05/07/2022	100.000
100.000.000	Sumitomo Trust and Banking Co. Ltd., 0.74%, 09/05/2022	100.000

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. GBP
100.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 03/10/2022	99.912
95.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 10/06/2022	94.926
95.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 12/08/2022	94.904

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 ICS STERLING LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. GBP
1.550.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 31/01/2022	1.550.213
1.010.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 21/03/2022	1.009.863
937.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, 0.00%, 09/05/2022	936.081
897.000.000	Nationwide Building Society, 1.81%, 16/09/2022	897.000
889.000.000	Nationwide Building Society, 1.76%, 23/09/2022	889.000
879.000.000	Nationwide Transportation, Inc., 1.19%, 23/06/2022	879.000
878.000.000	Nationwide Building Society, 0.94%, 17/06/2022	878.000
874.000.000	Nationwide Building Society, 1.19%, 05/07/2022	874.000
872.000.000	Nationwide Building Society, 1.19%, 11/07/2022	872.000
859.000.000	Nationwide Building Society, 1.69%, 11/08/2022	859.000
855.000.000	Nationwide Building Society, 1.69%, 06/09/2022	855.000
853.000.000	Nationwide Building Society, 1.19%, 29/06/2022	853.000
852.000.000	Nationwide Building Society, 1.19%, 05/08/2022	852.000
843.000.000	Nationwide Building Society, 1.19%, 15/07/2022	843.000
841.000.000	Nationwide Building Society, 0.94%, 14/06/2022	841.000
839.000.000	Nationwide Building Society, 1.19%, 21/07/2022	839.000
839.000.000	Nationwide Building Society, 1.19%, 02/08/2022	839.000
838.000.000	Nationwide Building Society, 1.19%, 27/07/2022	838.000
835.000.000	Nationwide Building Society, 1.69%, 17/08/2022	835.000
832.000.000	Nationwide Building Society, 0.94%, 30/05/2022	832.000

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. GBP
405.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 10/06/2022	404.685
405.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 12/08/2022	404.592
400.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 0.00%, 03/10/2022	399.646
71.000.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp., 0.00%, 19/09/2022	70.988
50.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp., 0.00%, 07/02/2022	49.997
50.000.000	UK Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2022	49.988

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 ICS STERLING ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. GBP
263.000.000	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares	263.000
80.000.000	Land Securities Group plc, 0.00%, 10/01/2022	79.988
80.000.000	Land Securities Group plc, 0.00%, 08/12/2021	79.979
80.000.000	Land Securities Group plc, 0.00%, 11/04/2022	79.914
80.000.000	Land Securities plc, 0.00%, 13/07/2022	79.913
80.000.000	Land Securities plc, 0.00%, 12/08/2022	79.904
80.000.000	Land Securities plc, 0.00%, 13/06/2022	79.864
80.000.000	Land Securities plc, 0.00%, 19/09/2022	79.840
75.000.000	UBS AGDiscount Notes, 0.71%, 25/11/2022	74.468
70.000.000	Credit Suisse AG, 0.71%, 07/12/2022	70.000
70.000.000	Societe Generale SADiscount Notes, 0.89%, 11/01/2023	69.376
70.000.000	Nordea Bank AbpDiscount Notes, 2.50%, 03/02/2023	69.118
70.000.000	Macquarie Bank Ltd.Discount Notes, 2.26%, 26/05/2023	68.430
70.000.000	Royal Bank of CanadaDiscount Notes, 3.12%, 18/07/2023	67.862
65.000.000	MUFG Bank Ltd., 2.00%, 23/09/2022	65.000
64.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp.Discount Notes, 2.11%, 14/10/2022	63.882
62.000.000	Bank of Montreal, 3.10%, 07/08/2023	62.000
60.000.000	National Australia Bank Ltd., 2.00%, 06/02/2023	60.000
60.000.000	Toronto-Dominion Bank (The), 0.80%, 21/10/2022	60.000
60.000.000	Managed and Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, 0.00%, 25/01/2022	60.000
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. GBP
288.000.000	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares	288.000
80.000.000	Land Securities plc, 0.00%, 19/09/2022	79.979
42.000.000	National Australia Bank Ltd., 1.13%, 10/11/2021	42.021
40.000.000	Realty Income Corp., 0.00%, 19/09/2022	39.993
15.000.000	Dexia Credit Local SA, 1.13%, 15/06/2022	15.074

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 ICS US DOLLAR LIQUID ENVIRONMENTALLY AWARE FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
175.000.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp., 0.00%, 02/12/2021	175.000
175.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 18/03/2022	174.998
175.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 08/04/2022	174.996
165.000.000	Automatic Data Processing, Inc., 0.00%, 08/03/2022	165.000
165.000.000	Automatic Data Processing, Inc., 0.00%, 07/12/2021	164.999
165.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 22/08/2022	164.968
160.000.000	DZ Bank AG, 0.00%, 23/12/2021	160.000
160.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 02/05/2022	159.996
158.139.000	Matchpoint Finance plc, 0.00%, 23/12/2021	158.139
155.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 23/12/2021	155.000
150.000.000	Automatic Data Processing, Inc., 0.00%, 23/11/2021	150.000
150.000.000	DZ Bank AG, 0.00%, 09/12/2021	150.000
150.000.000	DZ Bank AG, 0.00%, 01/03/2022	150.000
150.000.000	Credit Industriel et Commercial, 0.00%, 26/11/2021	149.999
150.000.000	Credit Industriel et Commercial, 0.00%, 27/09/2022	149.987
145.000.000	Credit Industriel et Commercial, 0.00%, 28/12/2021	145.000
145.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 26/11/2021	144.999
145.000.000	Erste Finance (Delaware) LLC, 0.00%, 13/09/2022	144.991
140.000.000	Automatic Data Processing, Inc., 0.00%, 03/11/2021	140.000
140.000.000	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA, 0.00%, 23/12/2021	140.000

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
34.500.000	Kommunalbanken A/S, 0.00%, 31/01/2022	34.493
30.000.000	Toronto-Dominion Bank (The), 0.11%, 26/11/2021	30.000
15.000.000	Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 09/03/2022	14.999
10.000.000	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 29/10/2021	10.000

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 ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
1.500.000.000	BNP Paribas SA, 0.00%, 13/09/2022	1.499.904
1.450.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 15/10/2021	1.450.000
1.450.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 22/10/2021	1.450.000
1.300.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 29/10/2021	1.300.000
1.250.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 19/11/2021	1.250.000
1.250.000.000	NWB Bank, 0.00%, 18/01/2022	1.249.984
1.160.000.000	DNB Bank ASA, 0.06%, 05/11/2021	1.160.000
1.150.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 17/12/2021	1.150.000
1.150.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 10/12/2021	1.150.000
1.150.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 03/12/2021	1.150.000
1.150.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 26/11/2021	1.150.000
1.150.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 12/11/2021	1.150.000
1.150.000.000	DNB Bank ASA, 0.00%, 23/12/2021	1.149.988
1.115.000.000	NWB Bank, 0.00%, 30/06/2022	1.114.358
1.100.000.000	DNB Bank ASA, 0.07%, 08/10/2021	1.100.000
1.074.499.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 27/12/2021	1.074.486
1.050.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 25/04/2022	1.049.969
1.036.427.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 27/04/2022	1.036.417
1.034.427.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 22/04/2022	1.034.417
1.020.000.000	Barclays Bank plc, 0.00%, 01/04/2022	1.019.990

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
312.000.000	Kommunalbanken A/S, 0.00%, 31/01/2022	311.936
307.000.000	Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 29/11/2021	306.977
295.000.000	Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 21/11/2022	295.091
276.000.000	Credit Suisse AG, FRN, 3.24%, 10/02/2023	275.475
250.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN, 1.20%, 14/11/2022	250.073
250.000.000	MUFG Bank Ltd., FRN, 3.40%, 07/11/2022	250.060
230.000.000	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 29/10/2021	229.991
200.000.000	Macquarie Bank Ltd., 0.00%, 09/03/2022	199.992
196.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 26/04/2022	195.980
180.000.000	Credit Suisse AG, FRN, 1.88%, 13/10/2022	180.034
154.500.000	Bank of Nova Scotia (The), FRN, 0.50%, 17/06/2022	154.500
150.000.000	Mizuho Bank Ltd., FRN, 0.00%, 21/09/2022	150.042
105.000.000	Credit Suisse AG, FRN, 0.00%, 09/02/2023	104.804
100.000.000	Barclays Bank plc, 0.40%, 16/06/2022	100.000
10.000.000	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 3.49%, 28/03/2023	10.007

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 ICS US DOLLAR ULTRA SHORT BOND FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
192.854.767	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares	192.855
100.000.000	Natixis SA, 0.00%, 31/12/2021	100.000
95.000.000	Fiserv, Inc., 0.00%, 03/06/2022	94.988
92.079.000	Hitachi America Capital Ltd., 0.00%, 28/07/2022	92.054
88.100.000	Eaton Capital Unlimited Co., 0.00%, 23/08/2022	88.062
88.000.000	Western Union Co. (The), 0.00%, 06/07/2022	87.996
86.000.000	VW Credit, Inc., 0.00%, 08/06/2022	85.974
85.000.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 13/06/2022	84.991
84.000.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 09/06/2022	83.998
82.300.000	Amphenol Corp., 0.00%, 05/08/2022	82.294
81.500.000	Sony Capital Corp., 0.00%, 21/09/2022	81.485
81.450.000	Hitachi America Capital Ltd., 0.00%, 21/07/2022	81.421
81.000.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 31/05/2022	80.988
80.300.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 15/06/2022	80.298
80.100.000	Fidelity National Information Services, Inc., 0.00%, 27/06/2022	80.068
80.000.000	Western Union Co. (The), 0.00%, 10/06/2022	79.998
80.000.000	Eaton Corp. plc, 0.00%, 20/07/2022	79.996
80.000.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 24/06/2022	79.996
80.000.000	Western Union Co. (The), 0.00%, 28/06/2022	79.996
80.000.000	Mondelez International, Inc., 0.00%, 14/06/2022	79.986
Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
150.021.499	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Agency (Dis) Shares	150.021
80.000.000	Hitachi America Capital Ltd., 0.00%, 11/08/2022	79.989
20.000.000	J.P. Morgan Securities plc, 0.00%, 21/03/2022	19.998
15.000.000	Hyundai Capital America, Inc., 0.00%, 11/01/2022	15.000
15.000.000	Hitachi America Capital Ltd., 0.00%, 12/01/2022	15.000
15.000.000	ING (US) Funding LLC, 0.00%, 17/12/2021	15.000
15.000.000	Enterprise Products Operating LLC, 0.00%, 14/03/2022	14.999
15.000.000	CDP Financial, Inc., 0.00%, 16/08/2022	14.993
10.000.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc, 0.27%, 15/03/2022	10.000
10.000.000	Goldman Sachs International Bank, FRN, 0.33%, 18/01/2023	10.000
10.000.000	ASB Finance Ltd., 0.00%, 18/03/2022	10.000
10.000.000	Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 0.00%, 29/10/2021	10.000
9.000.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 09/11/2021	8.999
5.818.000	Enel Finance America LLC, 0.00%, 22/10/2021	5.818
5.000.000	Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 10/12/2021	5.000
5.000.000	Goldman Sachs International Bank, 0.00%, 10/12/2021	5.000

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 ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Käufe		
Menge	Anlagen	Kosten Tsd. USD
2.417.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 02/12/2021	2.416.970
2.192.805.000	US Treasury Bill, 0.00%, 26/11/2021	2.192.701
2.200.000.000	US Treasury BillDiscount Notes, 2.93%, 15/11/2022	2.190.004
2.109.365.000	US Treasury Bill, 0.00%, 05/04/2022	2.108.895
1.960.920.000	US Treasury Bill, 0.00%, 14/12/2021	1.960.873
1.891.635.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/02/2022	1.891.478
1.797.432.100	US Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2021	1.797.363
1.661.015.000	US Treasury Bill, 0.00%, 17/05/2022	1.660.635
1.612.320.000	US Treasury Bill, 0.00%, 14/06/2022	1.611.204
1.600.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/03/2022	1.599.809
1.488.435.200	US Treasury Bill, 0.00%, 10/03/2022	1.488.263
1.292.050.000	US Treasury Bill, 0.00%, 16/06/2022	1.290.852
1.227.990.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/07/2022	1.227.664
1.188.550.000	US Treasury Bill, 0.00%, 19/05/2022	1.188.065
1.167.300.000	US Treasury Bill, 0.00%, 13/01/2022	1.167.256
1.161.740.000	US Treasury BillDiscount Notes, 3.53%, 16/03/2023	1.141.389
1.114.530.000	US Treasury Bill, 0.00%, 29/03/2022	1.114.352
1.100.698.200	US Treasury Bill, 0.00%, 16/12/2021	1.100.642
1.048.265.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/03/2022	1.048.183
1.046.820.000	US Treasury BillDiscount Notes, 2.49%, 20/10/2022	1.040.281
1.027.500.000	US Treasury Bill, 0.00%, 22/03/2022	1.027.433
954.260.000	US Cash Management Bill, 0.00%, 15/12/2021	954.221
951.485.000	US Treasury Bill, 0.00%, 28/06/2022	949.720
887.370.000	US Treasury Bill, 0.00%, 15/09/2022	886.809
864.045.000	US Treasury Bill, 0.00%, 20/01/2022	863.939
816.220.000	US Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2022	816.200
797.601.200	US Treasury Bill, 0.00%, 10/05/2022	797.244
794.856.100	US Treasury Bill, 0.00%, 12/04/2022	794.577
788.302.000	US Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2022	787.937
725.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 26/05/2022	724.304
722.170.000	US Treasury Bill, 0.00%, 01/03/2022	722.161
707.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/02/2022	706.979
682.610.000	US Cash Management Bill, 0.00%, 22/10/2021	682.593
666.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 15/02/2022	665.988

Verkäufe		
Menge	Anlagen	Erlöse Tsd. USD
2.109.365.000	US Treasury Bill, 0.00%, 05/04/2022	2.109.000
1.676.220.000	US Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2022	1.676.148
1.566.505.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/03/2022	1.566.383
1.343.034.000	US Treasury Bill, 0.00%, 10/03/2022	1.342.948
1.245.335.000	US Treasury Bill, 0.00%, 13/01/2022	1.245.319
1.219.750.000	US Treasury Bill, 0.00%, 16/06/2022	1.219.318
1.214.135.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/02/2022	1.214.048
1.212.325.000	US Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2022	1.212.210
1.114.530.000	US Treasury Bill, 0.00%, 29/03/2022	1.114.423
864.045.000	US Treasury Bill, 0.00%, 20/01/2022	863.984
814.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2021	813.971
797.268.300	US Treasury Bill, 0.00%, 10/05/2022	796.965
725.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 26/05/2022	724.527
694.856.100	US Treasury Bill, 0.00%, 12/04/2022	694.728
642.595.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/04/2022	642.456
600.698.200	US Treasury Bill, 0.00%, 16/12/2021	600.659
595.838.500	US Treasury Bill, 0.00%, 30/12/2021	595.773
587.460.000	US Treasury BillDiscount Notes, 2.49%, 20/10/2022	585.469
506.795.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/02/2022	506.747
475.000.000	US Treasury Bill, 0.00%, 22/03/2022	474.960
466.065.000	US Treasury Bill, 0.00%, 07/06/2022	465.869
453.100.000	US Treasury Bill, 0.00%, 31/03/2022	453.034
440.880.000	US Cash Management Bill, 0.00%, 22/10/2021	440.879
438.550.000	US Treasury Bill, 0.00%, 19/05/2022	438.279
391.140.000	US Treasury Bill, 0.00%, 30/06/2022	390.684
377.905.000	US Treasury Bill, 0.00%, 17/05/2022	377.741
373.205.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/03/2022	373.164

BLACKROCK ICS US TREASURY FUND

AUFSTELLUNGEN WESENTLICHER KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Verkäufe (Fortsetzung)		Erlöse
Menge	Anlagen	Tsd. USD
357.225.000	US Treasury Bill, 0.00%, 03/05/2022	357.102
355.025.000	US Treasury Bill, 0.00%, 24/05/2022	354.889
340.095.000	US Treasury Bill, 0.00%, 17/03/2022	340.067
330.328.300	US Treasury Bill, 0.00%, 16/08/2022	329.471

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER SCHWEIZ (UNGEPRÜFT)

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

Weitere Informationen über die herangezogenen Performanceindikatoren und Berechnungsmethoden sind dem Abschnitt Zusammenfassung der Wertentwicklung im Bericht des Investmentmanagers zu entnehmen.

Name des Fonds	Auflegungsdatum	2021		2020		2019	
		Fondsrendite %	Benchmarkrendite %	Fondsrendite %	Benchmarkrendite %	Fondsrendite %	Benchmarkrendite %
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	(0,75)	(0,57)	(0,76)	(0,62)	(0,68)	(0,53)
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Acc)	24. April 2013	(0,60)	(0,69)	(0,51)	(0,63)	(0,55)	(0,60)
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	(0,74)	(0,69)	(0,65)	(0,63)	(0,57)	(0,60)
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core	30. April 2010	(0,65)	(0,66)	(0,46)	(0,52)	(0,34)	(0,47)
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	23. September 2010	(0,01)	0,06	0,11	0,20	0,54	0,60
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis)	22. Juli 2019	0,00	(0,07)	0,17	0,06	k. A.	k. A.
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	0,01	(0,07)	0,19	0,06	0,64	0,57
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Core	30. April 2010	(0,05)	(0,06)	0,50	0,36	0,81	0,73
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund - Anteilklasse Core (Dis)	24. Juli 2019	0,02	(0,03)	0,52	0,30	k. A.	k. A.
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	0,02	(0,03)	0,53	0,30	2,66	2,06
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund - Anteilklasse Select	23. September 2010	0,08	0,05	1,16	0,75	2,68	2,36
BlackRock ICS US Treasury Fund - Anteilklasse Core (Acc)	30. April 2010	0,01	0,04	0,32	0,45	2,05	2,20

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. 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

Die TER für jede Anteilklasse, mit Ausnahme der primären Anteilklasse, ist in der folgenden Tabelle für den Zwölfmonatszeitraum zum 30. September 2022 angegeben:

Name des Fonds	Klasse des Fonds	TER (in %)
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03
	Anteilklasse G Accumulating	0,03
	Anteilklasse G Accumulating T0	0,10
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,03
	Anteilklasse Select (Acc T0)	0,01
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Anteilklasse Admin III (Acc)	0,45
	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,15
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,09
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,09
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,07
	Anteilklasse Premier (Acc T2)	0,07
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,07
	Anteilklasse Select (Acc T0)	0,00
	Anteilklasse Select (Acc)	0,10
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Anteilklasse Admin I (Acc T0)	0,00
	Anteilklasse Admin I (Acc)	0,25
	Anteilklasse Admin II (Acc)	0,30
	Anteilklasse Admin III (Acc T0)	0,00
	Anteilklasse Admin III (Acc)	0,45
	Anteilklasse Admin IV (Acc)	0,70
	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03
	Anteilklasse Aon Captives (Acc T0)	0,11
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,15
	Anteilklasse G Accumulating T0	0,10
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,09
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,09
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,07
	Anteilklasse Premier (Acc T2)	0,00
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,07
	Anteilklasse Select (Acc T0)	0,10
Anteilklasse Select (Acc)	0,11	
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	Anteilklasse Admin III	0,45
	Anteilklasse Agency	0,03
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,00
	Anteilklasse Heritage	0,13
	Anteilklasse J (Acc)	0,06
	Anteilklasse J (Dis)	0,06
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,00
	Anteilklasse Premier	0,10
	Anteilklasse Select	0,15
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,16
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,11
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,08
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,08
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Core (AccT0) Shares	0,00
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,12
	Anteilklasse Agency (Acc T3)	0,06
	Anteilklasse J (Dis T3)	0,00
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

Name des Fonds	Klasse des Fonds	TER (in %)
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Anteilklasse Admin I (Acc)	0,20
	Anteilklasse Admin I (Dis)	0,19
	Anteilklasse Admin II (Acc)	0,24
	Anteilklasse Admin II (Dis)	0,28
	Anteilklasse Admin III (Acc)	0,34
	Anteilklasse Admin III (Dis)	0,32
	Anteilklasse Admin IV (Acc)	0,35
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Aon Captives	0,15
	Anteilklasse Core (Dis)	0,16
	Anteilklasse G Distributing I	0,10
	Anteilklasse G Distributing II	0,00
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,12
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
	Anteilklasse S (Acc)	0,10
	Anteilklasse Select (Acc)	0,13
	Anteilklasse Select (Dis)	0,14
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Agency	0,03
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,00
	Anteilklasse Heritage	0,13
	Anteilklasse J (Acc)	0,06
	Anteilklasse J (Dis)	0,06
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
	Anteilklasse Premier	0,10
	Anteilklasse Select	0,15
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Anteilklasse Agency (Acc T0)	0,03
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,00
	Anteilklasse Core (Acc)	0,16
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,12
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
Anteilklasse Select (Dis)	0,13	
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Anteilklasse Admin I (Acc)	0,20
	Anteilklasse Admin I (Dis)	0,00
	Anteilklasse Admin II (Acc)	0,23
	Anteilklasse Admin II (Dis)	0,23
	Anteilklasse Admin III (Acc)	0,30
	Anteilklasse Admin III (Dis)	0,34
	Anteilklasse Admin IV (Acc)	0,45
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Aon Captives	0,15
	Anteilklasse Core (Acc T0)	0,20
	Anteilklasse Core (Dis)	0,17
	Klasse FA	0,00
	Anteilklasse G Accumulating II	0,20
	Anteilklasse G Accumulating	0,17
	Anteilklasse G Distributing I	0,15
	Anteilklasse G Distributing II	0,00
	Anteilklasse G Distributing	0,18
	Anteilklasse G Heritage (Acc)	0,12
	Anteilklasse G Heritage (Dis)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Acc T0)	0,13
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,13
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,13

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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

Name des Fonds	Klasse des Fonds	TER (in %)
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)	Klasse N	0,17
	Anteilklasse Premier (Acc T0)	0,10
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
	Anteilklasse Select (Acc)	0,15
	Anteilklasse Select (Dis)	0,15
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	Anteilklasse Agency	0,03
	Anteilklasse Core	0,20
	Anteilklasse Heritage (CHF Hedged)	0,15
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,00
	Anteilklasse Heritage (SGD Hedged)	0,15
	Anteilklasse Heritage	0,13
	Anteilklasse J (Acc)	0,06
	Anteilklasse J (Dis)	0,06
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,10
	Anteilklasse Premier	0,10
BlackRock ICS US Treasury Fund	Anteilklasse Admin III (Dis)	0,24
	Anteilklasse Agency (Acc)	0,03
	Anteilklasse Agency (Dis)	0,03
	Anteilklasse Core (Dis)	0,14
	Klasse FA	0,00
	Anteilklasse G Accumulating	0,20
	Anteilklasse G Distributing	0,20
	Anteilklasse G Heritage (Acc)	0,12
	Anteilklasse G Heritage (Dis)	0,12
	Anteilklasse Heritage (Acc)	0,10
	Anteilklasse Heritage (Dis)	0,10
	Klasse N	0,00
	Anteilklasse Premier (Acc)	0,10
	Anteilklasse Premier (Dis)	0,09
	Anteilklasse Select (Dis)	0,13

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN (UNGEPRÜFT)

Gemäß den Anforderungen der irischen Zentralbank hat die Verwaltungsgesellschaft sicherzustellen, dass alle zwischen den einzelnen Fonds und der Verwaltungsgesellschaft oder der Verwahrstelle der Fonds, den Beauftragten oder Unterbeauftragten der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von einer Verwahrstelle ernannter Unter-Depotbanken, die keine Konzerngesellschaften sind) sowie allen angeschlossenen oder Konzerngesellschaften der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle, der Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) ausgeführten Transaktionen zu marktüblichen Bedingungen und im besten Interesse der Anteilhaber 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)

Nicht alle Transaktionskosten sind gesondert ausweisbar. Bei bestimmten Schuldinstrumenten werden Transaktionskosten in den Kauf- und Verkaufspreis der Anlage einbezogen und nicht gesondert angegeben.

VERRECHNUNGSPROVISIONEN (SOFT COMMISSIONS) (UNGEPRÜFT)

Im Geschäftsjahr zum 30. September 2022 wurden vom Investmentmanager im Namen der jeweiligen Fonds keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen abgeschlossen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

WECHSELSEITIGE ANLAGEN (UNGEPRÜFT)

Jeder unten aufgeführte Fonds hielt zum 30. September 2022 die folgenden wechselseitigen Anlagen im Umbrella. Diese Anlagen wurden zu Darstellungszwecken der konsolidierten Ergebnisse des Unternehmens nicht eliminiert.

Fonds	Wechselseitige Anlagen im Umbrella	Zeitwert Tsd.	% des Gesamt- nettoinventar- werts des Umbrella
BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Acc T0)	1.349	0,00
BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis)	70.000	0,04
BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund - Anteilklasse Agency (Dis)	215.399	0,13

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 als „Commitment Approach“ bekannte Methode zur Messung des globalen Risikos der einzelnen Fonds und zur Steuerung potenzieller Verluste der Fonds aufgrund des Marktrisikos ein.

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

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

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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.

Die OGAW-Vergütungsrichtlinie von BlackRock (die „OGAW-Vergütungsrichtlinie“) findet Anwendung auf die EWG-Unternehmen in der BlackRock-Gruppe, die als Verwaltungsgesellschaft von OGAW-Fonds im Einklang mit der Richtlinie zugelassen sind, und stellt eine Einhaltung der Anforderungen von Artikel 14b der Richtlinie sicher.

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 verantwortlich für die Festlegung der Vergütungspolitik von BlackRock.

(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 2021 hat der MDCC acht 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 die Aufgabe, die für die Verwaltungsgesellschaft und ihre identifizierten Mitarbeiter geltende OGAW-Vergütungspolitik zu überwachen.

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Entscheidungsfindungsprozess (Fortsetzung)

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 und Internal Audit) verfügt über ihre eigene Organisationsstruktur, die von den Geschäftseinheiten unabhängig ist. 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.

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, 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 und
- Unverzichtbarkeit für die Geschäftstätigkeit.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Verbindung zwischen Zahlung und Leistung (Fortsetzung)

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 Tätigung 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 erdient werden können, beträgt 165 % der Prämie in Situationen, in denen beide Kennzahlen die vorgegebenen Finanzziele erreichen. Es werden keine Aktien erdient, 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.

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

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.

Es werden Angaben gemacht zu (a) den Mitarbeitern der Verwaltungsgesellschaft; (b) Mitarbeitern der Geschäftsleitung; und (c) Mitarbeitern, die das Risikoprofil des Fonds wesentlich beeinflussen können, einschließlich Personen, die zwar nicht direkt von der Verwaltungsgesellschaft angestellt sind, aber von ihrem Arbeitgeber beauftragt wurden, Dienstleistungen direkt für diese zu erbringen.

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).

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

VERGÜTUNGSBERICHT (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Quantitative Vergütungs offenbarung (Fortsetzung)

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 offengelegten Gesamtzahlen einbezogen, der dem Fonds 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. Daher stellen die offengelegten Zahlen eine Summe des jeweiligen Vergütungsanteils der betreffenden Personen dar, der der Verwaltungsgesellschaft zuzurechnen ist, berechnet anhand einer objektiven Zuordnungsmethode, die dem vielfältigen Dienstleistungsspektrum der Verwaltungsgesellschaft gerecht wird. Dementsprechend sind diese Zahlen nicht repräsentativ für die tatsächliche Vergütung einer Person oder für deren Vergütungsstruktur.

Die Gesamtvergütung, die die Verwaltungsgesellschaft im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 ihren Mitarbeitern gezahlt hat und die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft zuzurechnen war, beläuft sich auf 36,10 Mio. GBP. Diese Zahl setzt sich aus einer festen Vergütung von 15,22 Mio. GBP und einer variablen Vergütung von 20,88 Mio. GBP zusammen. Die vorstehend beschriebene Vergütung wurde an insgesamt 201 Empfänger gezahlt.

Die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft zuzurechnende Gesamtvergütung, die die Verwaltungsgesellschaft im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 gezahlt hat, betrug 1,70 Mio. GBP an Mitglieder der Geschäftsleitung und 34,40 Mio. GBP an andere Mitarbeiter, deren Tätigkeit wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds hat.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT)

Techniken des effizienten Portfoliomanagements

Der Verwaltungsrat kann für jeden Fonds und unter Einhaltung der von der CBI festgelegten Bedingungen und Grenzen Techniken und Instrumente in Bezug auf Wertpapiere zu Absicherungszwecken (um einen Vermögenswert eines Fonds gegen Schwankungen im Marktwert oder Währungsrisiken abzusichern oder das diesbezügliche Obligo gering zu halten) oder für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements (um eine Risikoreduzierung, eine Kostenreduzierung oder ein Wachstum von Kapital und laufenden Erträgen für den Fonds zu erzielen, sofern diese Transaktionen nicht spekulativer Natur sind) einsetzen. Anlagen in DFI, die ein Fremdwährungsrisiko mit sich bringen, werden nur zu Absicherungszwecken verwendet. Zu diesen Techniken und Instrumenten können Anlagen in börsengehandelten oder außerbörslichen DFI wie Futures und Devisenterminkontrakte (die zur Steuerung des Markt- bzw. Währungsrisikos eingesetzt werden können), Optionen (einschließlich Kauf- und Verkaufsoptionen, die zur effizienteren Kostengestaltung eingesetzt werden können), Swaps, einschließlich Credit Default Swaps (die zur Steuerung des Zins- bzw. Kreditrisikos eingesetzt werden können), und Differenzkontrakte (CFD) gehören. Ferner kann ein Fonds im Rahmen seiner Anlagestrategie in DFI investieren, wenn dies in der Anlagepolitik des Fonds entsprechend angegeben wird und vorausgesetzt, dass es sich bei den Kontrahenten dieser Transaktionen um Institutionen handelt, die einer sachverständigen Überwachung unterliegen und in Bezug auf OTC-Transaktionen den von der CBI zugelassenen Kategorien angehören.

Der Investmentmanager wendet in Bezug auf die Fonds einen Risikomanagementprozess gemäß den Anforderungen der Zentralbank an, der es ihm ermöglicht, das globale Risiko der einzelnen DFI („globales Risiko“) genau zu überwachen, zu messen und zu steuern. Der Investmentmanager setzt eine als „Commitment Approach“ bekannte Methode zur Messung des globalen Risikos der Fonds und zur Steuerung potenzieller Verluste der Fonds aufgrund des Marktrisikos ein. Die Gesellschaft wird den Anteilinhabern auf Aufforderung ergänzende Informationen in Bezug auf die für das Risikomanagement angewandten Methoden vorlegen, wozu u. a. auch die angewandten quantitativen Grenzwerte und alle jüngsten Entwicklungen in den Risiko- und Ertragsmerkmalen der Hauptanlagekategorien gehören.

Zusätzlich zu den oben genannten Anlagen in DFI können die Fonds andere Techniken und Instrumente in Bezug auf übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente unter Einhaltung der OGAW-Vorschriften und von der CBI auferlegten Bedingungen einsetzen, beispielsweise Pensionsgeschäfte/umgekehrte Repogeschäfte und Wertpapierleihen.

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.

Umgekehrte Repogeschäfte

Alle umgekehrten Repogeschäfte werden von jedem Fonds mit einem Kontrahenten im Rahmen eines Global Master Repurchase Agreement („GMRA“) abgeschlossen. Alle Sicherheiten, die ein jeder Fonds im Rahmen von GMRA erhält, werden bilateral gemäß einem Titelabtretungsvertrag übertragen. Die von den einzelnen Fonds erhaltenen Sicherheiten werden auf einem Konto im Namen der Verwahrstelle für jeden Fonds und im Falle von Dreiparteien-Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften mit einem Dreiparteien-Sicherheitenverwalter im Namen der Verwahrstelle für die einzelnen Fonds gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden von den Vermögenswerten der Verwahrstelle des Fonds getrennt.

Die nachstehende Tabelle enthält Angaben zu den umgekehrten Repogeschäften als prozentualer Anteil des Nettoinventarwerts der einzelnen Fonds zum 30. September 2022 und zu den Renditen im Geschäftsjahr zum 30. September 2022.

Fonds	Umgekehrte Repogeschäfte		
	Währung	% des NIW	Erzielte Gesamtrenditen Tsd.
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR	40,60	(47)
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	EUR	2,03	(1.253)
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	EUR	9,96	(27.528)
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP	81,40	15.953
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	GBP	10,56	8.695
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	GBP	15,01	39.009
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	USD	22,70	5.072
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	USD	19,11	39.401
BlackRock ICS US Treasury Fund	USD	56,04	114.040

Alle Renditen und Kosten aus umgekehrten Repogeschäften 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 enthält Angaben zum Wert der umgekehrten Repogeschäfte und zugehöriger erhaltener Sicherheiten, aufgeteilt nach Kontrahenten, zum 30. September 2022.

Kontrahent	Gründungsland der Kontrahenten	Umgekehrte Repogeschäfte	
		Entliehener Betrag Tsd. EUR	Erhaltene Sicherheiten Tsd. EUR
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund			
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	5.500	5.611
BofA Securities Europe SA	Frankreich	5.500	5.673
BNP Paribas SA	Frankreich	5.000	5.163
Gesamt		16.000	16.447
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund			
BNP Paribas SA	Frankreich	100.000	102.062

NM0223U-2714371-166/244

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

		Umgekehrte Repogeschäfte	
Kontrahent	Gründungsland der Kontrahenten	Entliehener Betrag	Erhaltene Sicherheiten
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)		Tsd. EUR	Tsd. EUR
Gesamt		100.000	102.062
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund		Tsd. EUR	Tsd. EUR
Natixis SA	Frankreich	800.000	815.164
BofA Securities Europe SA	Frankreich	800.000	811.563
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	794.500	817.970
ING Bank NV	Niederlande	750.000	750.742
MUFG Securities EMEA plc	Vereinigtes Königreich	300.000	308.336
BNP Paribas SA	Frankreich	100.000	102.244
Gesamt		3.544.500	3.606.019
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund		Tsd. GBP	Tsd. GBP
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	455.068	455.067
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	306.539	306.539
MUFG Securities EMEA plc	Vereinigtes Königreich	301.200	301.201
Standard Chartered Bank	Vereinigtes Königreich	253.673	253.673
Barclays Bank plc	Vereinigtes Königreich	200.000	206.613
Societe Generale SA	Frankreich	200.000	210.076
National Australia Bank Ltd.	Australien	200.000	220.569
Toronto-Dominion Bank (The)	Kanada	183.776	183.776
BNP Paribas SA	Frankreich	157.000	168.735
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	153.469	153.469
Santander UK plc	Vereinigtes Königreich	152.751	152.751
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	Frankreich	101.702	101.702
Gesamt		2.665.178	2.714.171
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund		Tsd. GBP	Tsd. GBP
Santander UK plc	Vereinigtes Königreich	258.154	258.154
Barclays Bank plc	Vereinigtes Königreich	200.000	215.907
BNP Paribas SA	Frankreich	193.000	205.807
Toronto-Dominion Bank (The)	Kanada	103.800	103.799
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	103.636	103.636
Standard Chartered Bank	Vereinigtes Königreich	100.568	100.568
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	100.166	100.167
Gesamt		1.059.324	1.088.038
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund		Tsd. GBP	Tsd. GBP
MUFG Securities EMEA plc	Vereinigtes Königreich	1.205.282	1.205.283
Santander UK plc	Vereinigtes Königreich	1.089.316	1.089.317
Toronto-Dominion Bank (The)	Kanada	920.352	920.354
Bank of Nova Scotia plc	Kanada	804.493	804.491
Citigroup Global Markets Ltd.	Vereinigtes Königreich	800.000	890.034
Standard Chartered Bank	Vereinigtes Königreich	552.037	552.035
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	153.942	153.942
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	Frankreich	152.588	152.588
BNP Paribas SA	Frankreich	150.000	163.629
Barclays Bank plc	Vereinigtes Königreich	100.000	105.226
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	100.000	105.499
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	53.494	53.494
Gesamt		6.081.504	6.195.892
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund		Tsd. USD	Tsd. USD
BofA Securities, Inc.	Vereinigtes Königreich	403.000	411.442
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten	300.000	304.310
Citigroup Global Markets, Inc.	Vereinigte Staaten	200.000	202.928
BNP Paribas SA	Frankreich	20.000	20.102
Gesamt		923.000	938.782
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund		Tsd. USD	Tsd. USD
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten	4.605.000	4.667.835
Goldman Sachs & Co. LLC	Vereinigte Staaten	2.480.000	2.521.830
BNP Paribas SA	Frankreich	2.384.000	2.417.003
BofA Securities, Inc.	Vereinigtes Königreich	1.296.000	1.325.064
Citigroup Global Markets, Inc.	Vereinigte Staaten	1.090.000	1.102.507
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	Frankreich	375.000	380.580
Gesamt		12.230.000	12.414.819
BlackRock ICS US Treasury Fund		Tsd. USD	Tsd. USD
Fixed Income Clearing Corp. JPM	Vereinigte Staaten	2.600.000	2.600.000
BNP Paribas SA	Frankreich	2.400.000	2.425.290
Credit Suisse AG	Schweiz	1.690.000	1.709.245
Citigroup Global Markets, Inc.	Vereinigte Staaten	1.245.000	1.259.666

NM0223U-2714371-167/244

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

		Umgekehrte Repogeschäfte	
Kontrahent	Gründungsland der Kontrahenten	Entliehener Betrag	Erhaltene Sicherheiten
		Tsd. USD	Tsd. USD
BlackRock ICS US Treasury Fund (Fortsetzung)			
BofA Securities, Inc.	Vereinigtes Königreich	1.159.000	1.165.679
Barclays Capital, Inc.	Vereinigtes Königreich	996.000	1.004.312
Societe Generale SA	Frankreich	955.000	965.516
TD Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten	900.000	906.837
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	Frankreich	115.001	116.506
Gesamt		12.060.001	12.153.051

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse des Fälligkeitsprofils der umgekehrten Repogeschäfte zum 30. September 2022.

		Fälligkeitsprofil		
		2-7 Tage	Gesamt	
		Tsd.	Tsd.	Tsd.
Währung				
Umgekehrte Repogeschäfte				
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	EUR	16.000	16.000	
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	EUR	100.000	100.000	
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	EUR	3.544.500	3.544.500	
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	GBP	2.665.178	2.665.178	
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	GBP	1.059.324	1.059.324	
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	GBP	6.081.504	6.081.504	
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	USD	923.000	923.000	
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	USD	12.230.000	12.230.000	
BlackRock ICS US Treasury Fund	USD	12.060.001	12.060.001	

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

Analyse der Sicherheitenwährung

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse nach Währung der Bar- und Sachsicherheiten, die der jeweilige Fonds zum 30. September 2022 über einen Titelabtretungsvertrag in Bezug auf Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften erhalten hat.

Währung	Erhaltene Sachsicherheiten
	Tsd. EUR
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	
Umgekehrte Repogeschäfte	
EUR	16.447
Gesamt	16.447
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	
Umgekehrte Repogeschäfte	
EUR	102.062
Gesamt	102.062
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	
Umgekehrte Repogeschäfte	
EUR	3.606.019
Gesamt	3.606.019
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	
Umgekehrte Repogeschäfte	
GBP	2.714.171
Gesamt	2.714.171
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	
Umgekehrte Repogeschäfte	
GBP	1.088.038
Gesamt	1.088.038
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	
Umgekehrte Repogeschäfte	
GBP	6.195.892
Gesamt	6.195.892
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	
Umgekehrte Repogeschäfte	
USD	938.782
Gesamt	938.782
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
Umgekehrte Repogeschäfte	
USD	116.506
Gesamt	116.506

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Analyse der Sicherheitenwährung (Fortsetzung)

Währung	Erhaltene Sachsicherheiten
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund (Fortsetzung)	Tsd. USD
USD	12.414.819
Gesamt	12.414.819
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD
Umgekehrte Repogeschäfte	
USD	12.153.051
Gesamt	12.153.051

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

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 umgekehrte Repogeschäfte erhaltenen Sachsicherheiten zum 30. September 2022.

Art und Qualität der Sicherheit	Fälligkeitsprofil						Offen	Gesamt
	1 Tag	2 - 7 Tage	8 - 30 Tage	31 - 90 Tage	91 - 365 Tage	Mehr als 365 Tage		
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	65	608	1.711	14.063	–	16.447
Gesamt	–	–	65	608	1.711	14.063	–	16.447
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	44.786	–	24.685	32.591	–	102.062
Gesamt	–	–	44.786	–	24.685	32.591	–	102.062
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR	Tsd. EUR
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	1.800	190.633	155.736	589.823	2.668.027	–	3.606.019
Gesamt	–	1.800	190.633	155.736	589.823	2.668.027	–	3.606.019
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	–	–	–	2.714.171	–	2.714.171
Gesamt	–	–	–	–	–	2.714.171	–	2.714.171
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	–	24.190	41.042	1.022.806	–	1.088.038
Gesamt	–	–	–	24.190	41.042	1.022.806	–	1.088.038
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP	Tsd. GBP
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	–	–	86.607	60.945	6.048.340	–	6.195.892
Gesamt	–	–	–	86.607	60.945	6.048.340	–	6.195.892
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

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

Art und Qualität der Sicherheit	Fälligkeitsprofil						Offen	Gesamt
	1 Tag	2 - 7 Tage	8 - 30 Tage	31 - 90 Tage	91 - 365 Tage	Mehr als 365 Tage		
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Fortsetzung)	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Investment-Grade	–	–	–	–	37.980	900.802	–	938.782
Gesamt	–	–	–	–	37.980	900.802	–	938.782
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	471.253	471.227	262.130	337.002	10.873.207	–	12.414.819
Gesamt	–	471.253	471.227	262.130	337.002	10.873.207	–	12.414.819
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD	Tsd. USD
Erhaltene Sicherheiten – umgekehrte Repogeschäfte								
Festverzinsliche Wertpapiere								
Investment-Grade	–	93	974	32.647	1.988.594	10.130.743	–	12.153.051
Gesamt	–	93	974	32.647	1.988.594	10.130.743	–	12.153.051

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. Das Fälligkeitsprofil für die als Sicherheit erhaltenen festverzinslichen Wertpapiere basiert auf dem jeweiligen vertraglichen Fälligkeitstermin.

Weiterverwendung der erhaltenen Sicherheiten

Sachsicherheiten, die über einen Titelabtretungsvertrag in Bezug auf umgekehrte Repogeschäfte erhalten wurden, können verkauft, reinvestiert oder verpfändet werden.

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Zum 30. September 2022 werden alle Sachsicherheiten, die jeder Fonds im Rahmen von umgekehrten Repogeschäften erhält, von der Verwahrstelle des Fonds (oder durch ihre Beauftragten) gehalten, mit Ausnahme von Dreiparteien-Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften, die bei dem Dreiparteien-Agenten gehalten werden.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT UND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Konzentration der erhaltenen Sicherheiten

Die nachstehende Tabelle führt die zehn größten Emittenten nach Wert der vom jeweiligen Fonds über einen Titelabtretungsvertrag erhaltenen Sachsicherheiten für Transaktionen mit umgekehrten Repogeschäften zum 30. September 2022 auf.

Emittent	Wert
BlackRock ICS Euro Government Liquidity Fund	Tsd. EUR
Frankreich Staatsanleihe	7.955
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	3.720
Niederlande Staatsanleihe	1.734
Bundesobligation	1.280
Finnland Staatsanleihe	1.084
Bundesschatzanweisungen	608
Deutsche Staatsanleihe	66
Gesamt	16.447
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. EUR
Deutsche Staatsanleihe	53.102
Bundesschatzanweisungen	28.520
Bundesobligation	16.370
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4.070
Gesamt	102.062
BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	Tsd. EUR
Frankreich Staatsanleihe	1.868.136
Niederlande Staatsanleihe	698.490
Deutsche Staatsanleihe	382.478
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	261.011
Finnland Staatsanleihe	183.641
Bundesschatzanweisungen	138.284
Bundesobligation	73.979
Gesamt	3.606.019
BlackRock ICS Sterling Government Liquidity Fund	Tsd. GBP
UK Treasury	2.714.171
Gesamt	2.714.171
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. GBP
UK Treasury	1.088.038
Gesamt	1.088.038
BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	Tsd. GBP
UK Treasury	6.195.892
Gesamt	6.195.892
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	Tsd. USD
Freddie Mac	411.442
Ginnie Mae	304.310
US Treasury	223.030
Gesamt	938.782
BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	Tsd. USD
US Treasury	6.102.572
Ginnie Mae	4.829.292
Fannie Mae	1.409.835
Federal Home Loan Bank (FHL-Banken)	71.226
Freddie Mac	1.894
Gesamt	12.414.819
BlackRock ICS US Treasury Fund	Tsd. USD
US Treasury	12.147.847
Strips TII Princ	5.204
Gesamt	12.153.051

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Glossar und Schlüsseldefinitionen

Die nachstehenden Angaben im regelmäßigen Bericht beziehen sich auf das Jahr bis zum 30. September 2022 (der „Bezugszeitraum“).

Alle für die Anlagen des Fonds und andere angegebene quantitative Kennzahlen dargestellten Angaben wurden auf der Grundlage eines einfachen Durchschnitts des Wertes der gehandelten und gehaltenen Anlagen zu jedem Quartalsende innerhalb des Bezugszeitraums berechnet. 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.

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.

SFDR-Berichtsangaben

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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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 ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung:

549300TSWW0QQLCYQP55

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> 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, enthält 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



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.

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

Von dem Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen

Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen

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

Angestrebte 80 % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel) weisen überdurchschnittliche Umweltbewertungen gemäß den MSCI-Ratingkriterien auf („Inclusionary Environmental Tilt“)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Angestrebte 80 % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel) weisen überdurchschnittliche Umweltbewertungen gemäß den MSCI-Ratingkriterien auf („Inclusionary Environmental Tilt“)	% der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen	100 %

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsindikatoren, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereicher-tes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerksohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	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
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	P	P		
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen				P
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F			

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

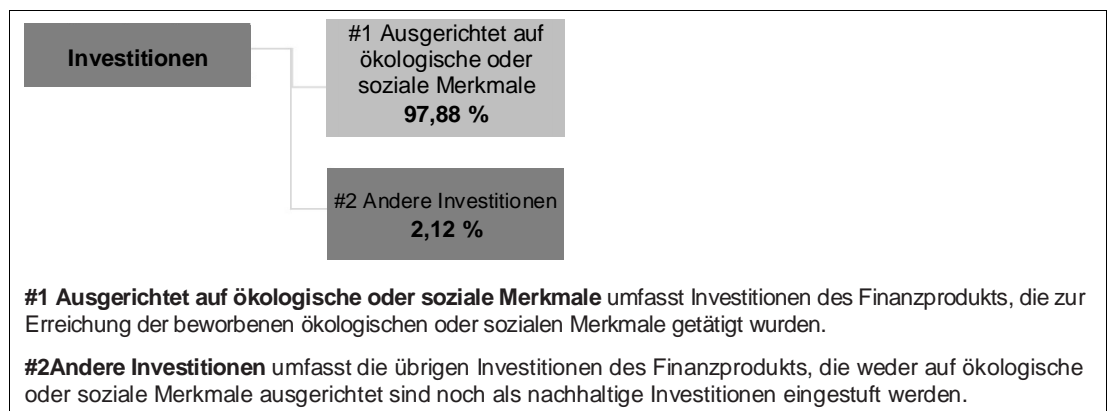
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	2,35 %	Deutschland
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	2,12 %	Deutschland
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,88 %	Deutschland
Barclays Bank Plc	Finanzinstitute	1,88 %	Vereinigtes Königreich
Erste Group Bank AG Euro	Finanzinstitute	1,79 %	Österreich
KBC Bank (Zweigniederlassung London) Euro	Finanzinstitute	1,69 %	Vereinigtes Königreich
Tri-party BNP Paribas	Finanzinstitute	1,65 %	Europäische Union
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,65 %	Deutschland
Societe Generale SA Euro	Finanzinstitute	1,41 %	Frankreich
Bank Of Nova Scotia Euro	Finanzinstitute	1,18 %	Kanada
Bank Of Nova Scotia Euro	Finanzinstitute	1,18 %	Kanada
Societe Generale SA Euro	Finanzinstitute	1,18 %	Frankreich
Bred Banque Populaire Euro	Finanzinstitute	1,18 %	Frankreich
Erste Group Bank AG	Finanzinstitute	1,13 %	Österreich
Purple Protected Asset SA MTN Regs	Finanzinstitute	1,13 %	Luxemburg



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.



- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilssektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	73,00 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	6,87 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	5,72 %
Kommunalanleihen	Sonstige	4,35 %
Finanzinstitute	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	3,34 %
Industrie	Basiskonsumgüter	2,10 %
Industrie	Investitionsgüter	1,74 %
Industrie	Technologie	1,48 %
Agency-Anleihen	Gehalten Ohne Garantie	1,22 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

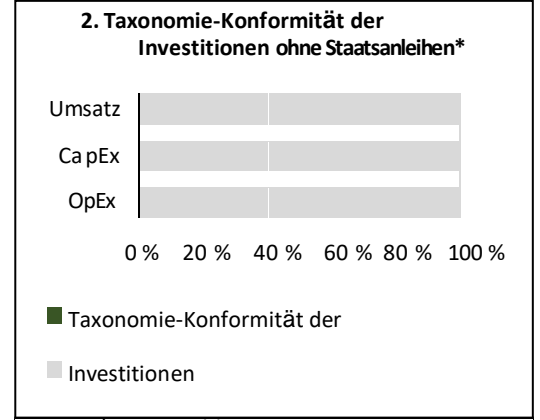
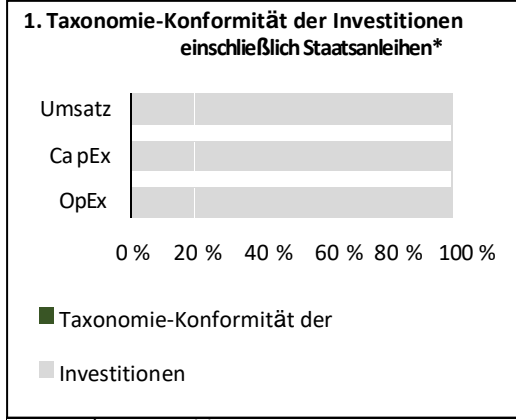
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

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.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**
Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.

*Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

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 von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock ICS Euro Liquidity Fund

Unternehmenskennung:

549300YBCJ4SKWVANO22

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 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, enthält 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, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle erzielen

Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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.	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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 hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F	P	P	P

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

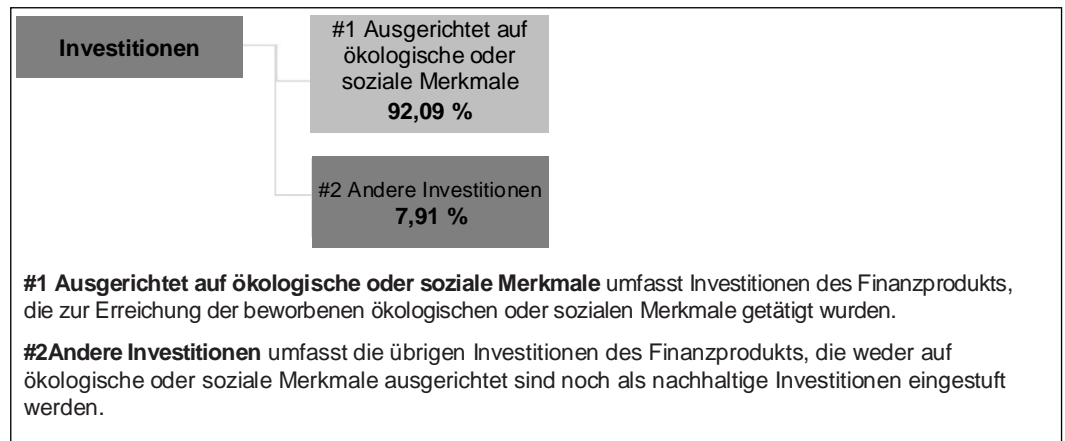
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,39 %	Deutschland
BPCE SA	Finanzinstitute	1,27 %	Frankreich
Erste Group Bank AG Euro	Finanzinstitute	1,20 %	Österreich
Standard Chartered Bank Regs	Finanzinstitute	1,18 %	Vereinigtes Königreich
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,11 %	Deutschland
Basler Kantonalbank Euro	Kommunalanleihen	0,97 %	Schweiz
Purple Protected Asset SA MTN	Finanzinstitute	0,97 %	Luxemburg
Basler Kantonalbank Euro	Kommunalanleihen	0,97 %	Schweiz
Niederlande (Königreich)	US-Schatzwechsel	0,88 %	Niederlande
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	0,83 %	Deutschland
Purple Protected Asset SA MTN Regs	Finanzinstitute	0,83 %	Luxemburg
Barclays Bank plc	Finanzinstitute	0,76 %	Vereinigtes Königreich
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	0,70 %	Deutschland
La Banque Postale Regs	Agency-Anleihen	0,70 %	Frankreich
Sumitomo Mitsui Banking Corp (Brüssel)	Finanzinstitute	0,67 %	Belgien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerte an.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	62,74 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	7,23 %
Kommunalanleihen	Sonstige	5,04 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	4,47 %
Sonstige	Sonstige	4,41 %
Supranational	Sonstige	3,80 %
US-Schatzwechsel	Sonstige	3,63 %
Agency-Anleihen	Gehalten Ohne Garantie	2,48 %
Finanzinstitute	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	2,21 %
Agency-Anleihen	Von der Regierung garantiert	1,60 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

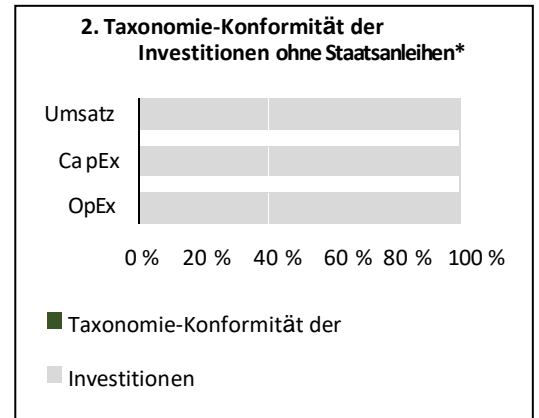
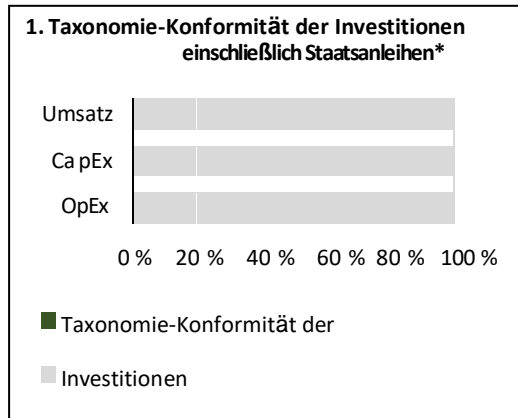
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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.

 *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?**

Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



- **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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

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 von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock ICS Euro Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung:

549300MWO3KX3D7D2N57

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 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, enthält 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, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle erzielen

Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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.	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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 hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind		P	P	
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen				P
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F			

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

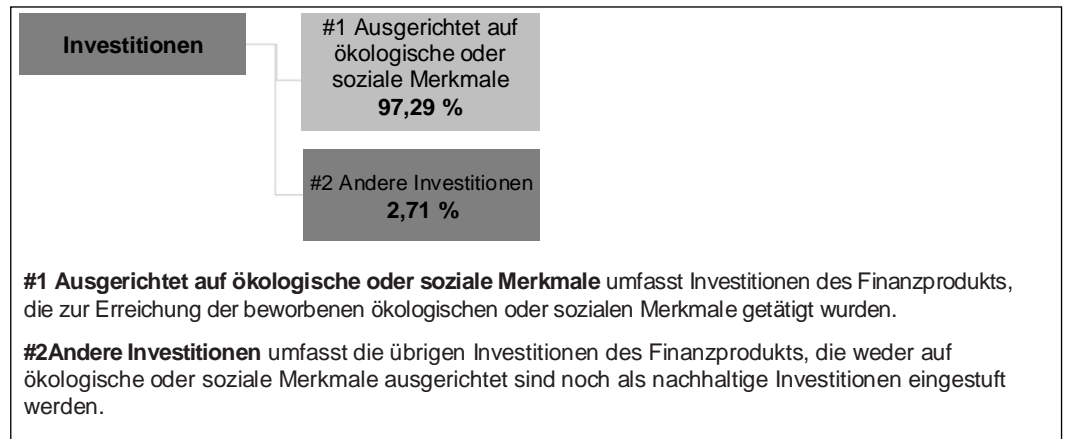
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Macquarie Bank Ltd MTN Regs	Finanzinstitute	3,79 %	Australien
Nordea Bank AB	Finanzinstitute	3,34 %	Vereinigtes Königreich
Credit Suisse AG (Zweigniederlassung London) MTN Regs	Finanzinstitute	2,92 %	Vereinigtes Königreich
HSBC Bank plc MTN Regs	Finanzinstitute	2,42 %	Vereinigtes Königreich
Zuercher Kantonalbank	Kommunalanleihen	2,23 %	Schweiz
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft	Finanzinstitute	2,05 %	Schweiz
Op Corporate Bank plc MTN Regs	Finanzinstitute	2,01 %	Finnland
Standard Chartered Bank	Finanzinstitute	1,81 %	Vereinigtes Königreich
Toyota Motor Finance (Niederlande) MTN Regs	Industrie	1,79 %	Niederlande
Toyota Motor Finance (Niederlande) MTN Regs	Industrie	1,79 %	Niederlande
Purple Protected Asset SA MTN Regs	Finanzinstitute	1,60 %	Luxemburg
Purple Protected Asset SA MTN	Finanzinstitute	1,59 %	Luxemburg
Barclays Bank plc	Finanzinstitute	1,51 %	Vereinigtes Königreich
Barclays Bank plc	Finanzinstitute	1,51 %	Vereinigtes Königreich
HSBC Continental Europe SA Regs	Finanzinstitute	1,45 %	Frankreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerte an.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	50,31 %
Industrie	Technologie	7,04 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	6,90 %
Industrie	Zyklische Konsumgüter	4,87 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	4,68 %
Kommunalanleihen	Sonstige	4,01 %
Industrie	Basiskonsumgüter	3,91 %
Versorger	Strom	3,89 %
Agency-Anleihen	Gehalten Ohne Garantie	3,55 %
Industrie	Investitionsgüter	2,92 %
Versorger	Erdgas	1,62 %
Finanzinstitute	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	1,08 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

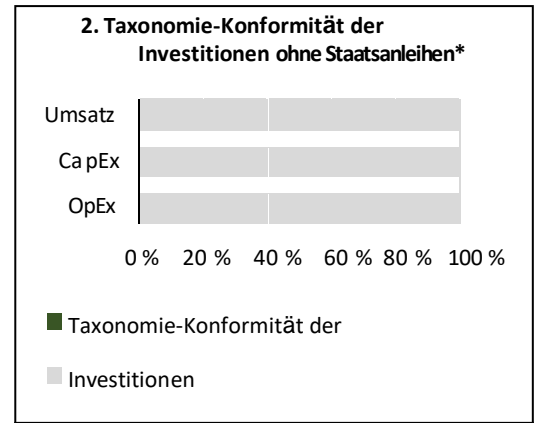
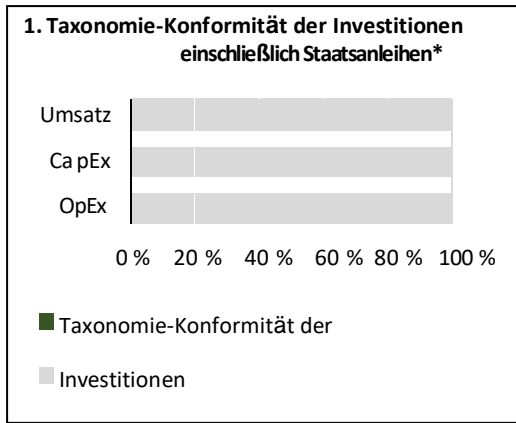
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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.

 *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?**

Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

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 von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung:

549300PS1MQ5RT4H4U08

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, enthält 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
	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel

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 mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen
- 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 Angestrebte 80 % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel) weisen überdurchschnittliche Umweltbewertungen gemäß den MSCI-Ratingkriterien auf („Inclusionary Environmental Tilt“)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Angestrebte 80 % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel) weisen überdurchschnittliche Umweltbewertungen gemäß den MSCI-Ratingkriterien auf („Inclusionary Environmental Tilt“)	% der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen	100 %

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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 hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind		P	P	
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen				P
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F			

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,64 %	Deutschland
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,64 %	Deutschland
DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss	Finanzinstitute	1,47 %	Deutschland
Banque Federative Du Credit Mutuel	Finanzinstitute	1,31 %	Frankreich
Toronto-Dominion Bank (Zweigniederlassung London)	Finanzinstitute	1,31 %	Vereinigtes Königreich
Mizuho Bank Ltd (Zweigniederlassung London) GB	Finanzinstitute	1,15 %	Vereinigtes Königreich
Banco Santander SA GB	Finanzinstitute	1,15 %	Spanien
Mizuho Bank Ltd (Zweigniederlassung London) GB	Finanzinstitute	1,15 %	Vereinigtes Königreich
Toronto-Dominion Bank (Zweigniederlassung London)	Finanzinstitute	0,98 %	Vereinigtes Königreich
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd (London)	Finanzinstitute	0,98 %	Vereinigtes Königreich
Mizuho Bank Ltd (Zweigniederlassung London) GB	Finanzinstitute	0,98 %	Vereinigtes Königreich
Mizuho Bank Ltd (Zweigniederlassung London) GB	Finanzinstitute	0,98 %	Vereinigtes Königreich
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd (London)	Finanzinstitute	0,98 %	Vereinigtes Königreich
Tri-party Barclays Bank plc	Finanzinstitute	0,98 %	Vereinigtes Königreich
Bank Of Nova Scotia GB	Finanzinstitute	0,98 %	Kanada



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerte an.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	84,92 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	3,53 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	3,40 %
US-Schatzwechsel	Sonstige	2,78 %
Finanzinstitute	Versicherungen	1,54 %
Industrie	Zyklische Konsumgüter	1,27 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

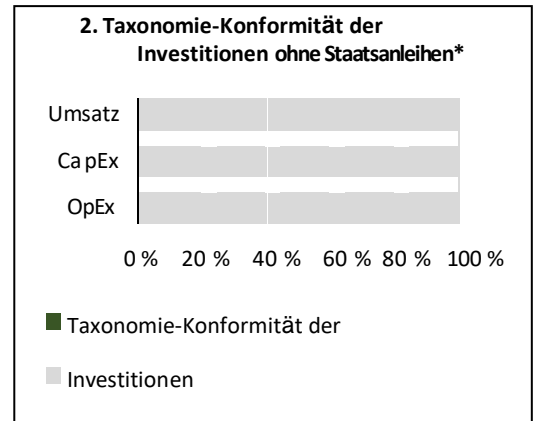
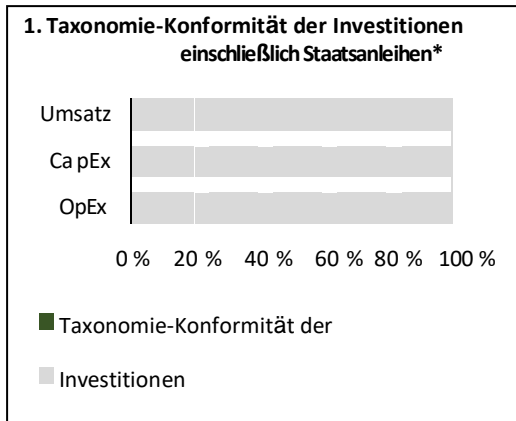
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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.



*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?**

Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

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 von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund

Unternehmenskennung:

549300KXRVZGAAWQCG88

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 ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthält 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 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

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 mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle erzielen

Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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.	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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 hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder einem anderen externen ESG-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F	P	P	P

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

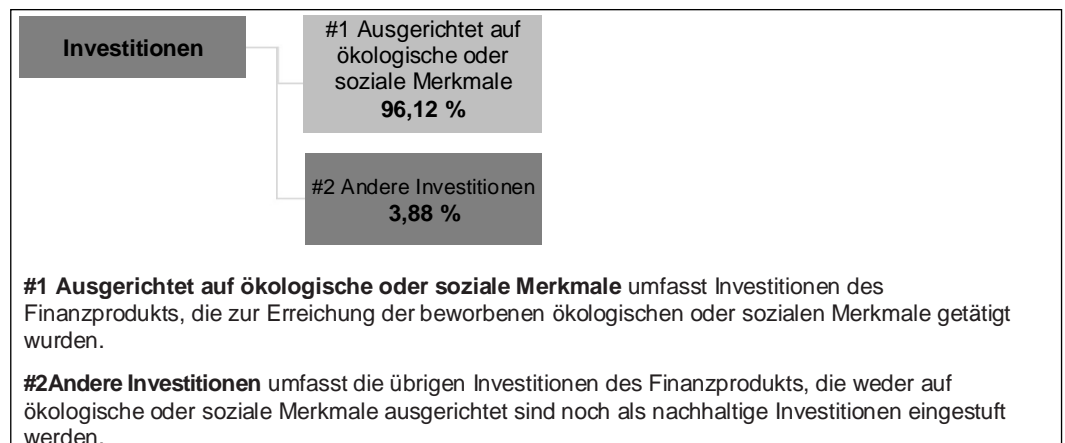
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Toronto-Dominion Bank (Zweigniederlassung London)	Finanzinstitute	1,37 %	Vereinigtes Königreich
Canadian Imperial Bank of Commerce MTN Regs	Finanzinstitute	1,23 %	Kanada
Toronto-Dominion Bank (Zweigniederlassung London)	Finanzinstitute	1,15 %	Vereinigtes Königreich
Vereinigtes Königreich	US-Schatzwechsel	1,06 %	Vereinigtes Königreich
Bank of Nova Scotia MTN Regs	Finanzinstitute	0,92 %	Kanada
National Australia Bank Ltd (London)	Finanzinstitute	0,91 %	Vereinigtes Königreich
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd (London)	Finanzinstitute	0,89 %	Vereinigtes Königreich
Bank of Nova Scotia MTN Regs	Finanzinstitute	0,87 %	Kanada
Bank of Nova Scotia MTN Regs	Finanzinstitute	0,83 %	Kanada
Toronto-Dominion Bank (Zweigniederlassung London)	Finanzinstitute	0,81 %	Vereinigtes Königreich
Banque Federative Du Credit Mutuel	Finanzinstitute	0,76 %	Frankreich
National Australia Bank Ltd (London)	Finanzinstitute	0,73 %	Vereinigtes Königreich
Standard Chartered Bank	Finanzinstitute	0,73 %	Vereinigtes Königreich
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd (London)	Finanzinstitute	0,68 %	Vereinigtes Königreich
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd (London)	Finanzinstitute	0,68 %	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerte an.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	80,46 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	4,83 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	4,11 %
Sonstige	Sonstige	2,87 %
Agency-Anleihen	Von der Regierung garantiert	2,36 %
Kommunalanleihen	Sonstige	2,28 %
US-Schatzwechsel	Sonstige	1,16 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

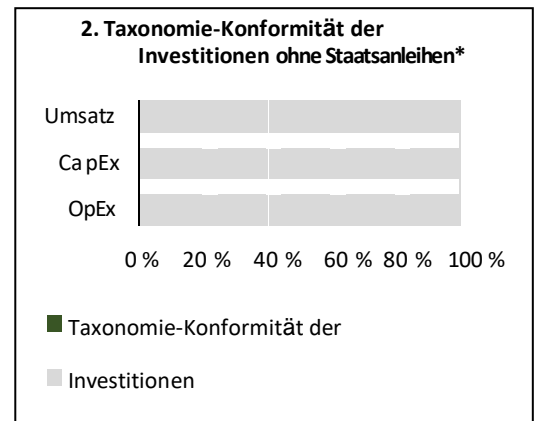
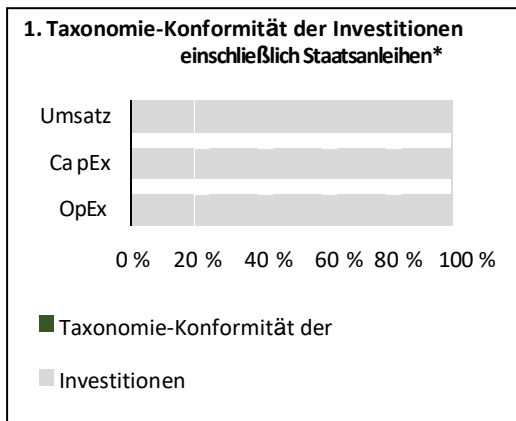
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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.

 *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?**

Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



- **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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

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 von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock ICS Sterling Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung:

5493003GYYZKMWFM4I31

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> 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 ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthält 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 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

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 mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle erzielen

Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen

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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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.	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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 hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	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
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind		P	P	
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen				P
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F			

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

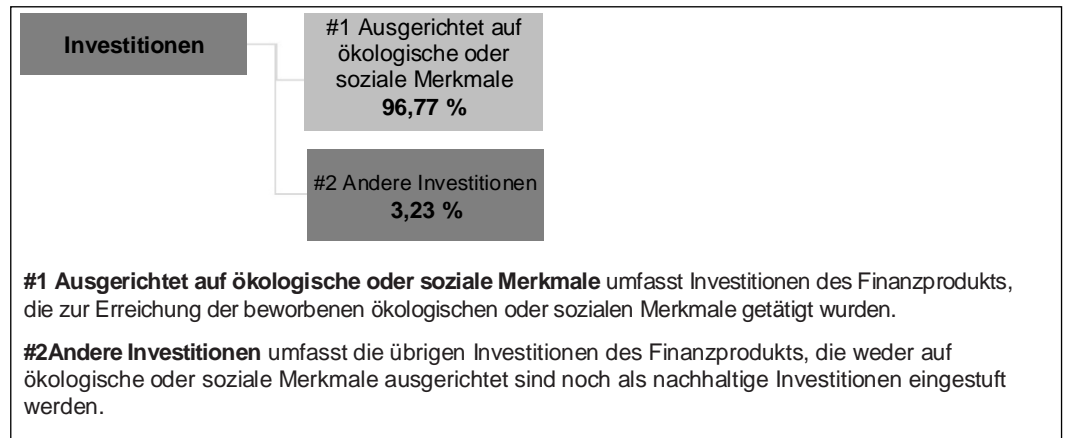
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Toyota Motor Finance (Niederlande) MTN Regs	Industrie	5,58 %	Niederlande
HSBC Bank plc MTN Regs	Finanzinstitute	4,60 %	Vereinigtes Königreich
UBS AG (Zweigniederlassung London) Regs	Finanzinstitute	4,14 %	Vereinigtes Königreich
Credit Suisse AG (Zweigniederlassung London)	Finanzinstitute	3,89 %	Vereinigtes Königreich
Lloyds Bank Corporate Markets plc	Finanzinstitute	3,75 %	Vereinigtes Königreich
Blk ICS GBP Liq Agency	STIF Funds	3,66 %	Irland
Toronto-Dominion Bank (Zweigniederlassung London)	Finanzinstitute	3,35 %	Vereinigtes Königreich
Banque Federative Du Credit Mutuel	Finanzinstitute	3,32 %	Frankreich
Jyske Bank A/S Regs	Finanzinstitute	3,12 %	Dänemark
Societe Generale (Zweigniederlassung London)	Finanzinstitute	2,88 %	Vereinigtes Königreich
ING Bank NV Regs	Finanzinstitute	2,50 %	Niederlande
MUFG Bank Ltd (Zweigniederlassung London) GB	Finanzinstitute	2,09 %	Vereinigtes Königreich
MUFG Bank Ltd (Zweigniederlassung London) GB	Finanzinstitute	2,09 %	Vereinigtes Königreich
Henkel AG & Co Kgaa Regs	Industrie	2,09 %	Deutschland
MUFG Bank Ltd (Zweigniederlassung London) GB	Finanzinstitute	1,95 %	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerte an.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	59,04 %
Industrie	Zyklische Konsumgüter	8,33 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	6,00 %
Finanzinstitute	REITs	4,06 %
STIF Funds	Sonstige	3,66 %
Industrie	Technologie	3,22 %
Versorger	Strom	3,14 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	2,52 %
Industrie	Basiskonsumgüter	2,09 %
Gedekte Anleihen	Besicherte Hypotheken	1,93 %
Versorger	Erdgas	1,21 %
Industrie	Energie	1,16 %
Industrie	Investitionsgüter	1,07 %
Industrie	Sonstige Industrierwerte	0,61 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

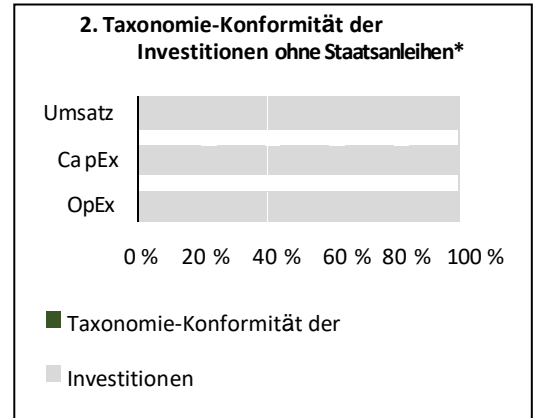
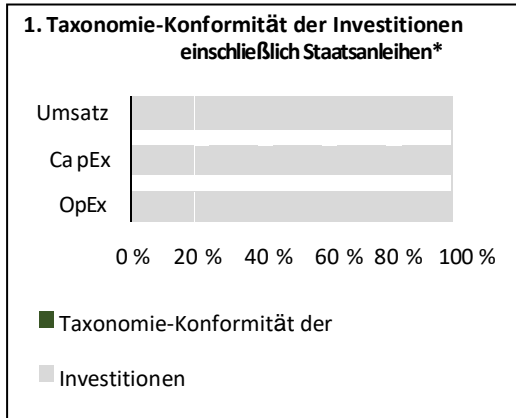
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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.



*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?**

Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



- **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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

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 von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund

Unternehmenskennung:

549300OKSM0SGPTHJ605

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <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, enthält 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
	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel

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 mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen

Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen

Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen

Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen

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 Angestrebte 80 % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel) weisen überdurchschnittliche Umweltbewertungen gemäß den MSCI-Ratingkriterien auf („Inclusionary Environmental Tilt“)

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Angestrebte 80 % der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel) weisen überdurchschnittliche Umweltbewertungen gemäß den MSCI-Ratingkriterien auf („Inclusionary Environmental Tilt“)	% der Vermögenswerte des Fonds (ohne Zahlungsmittel), die eine überdurchschnittliche Umweltbewertung gemäß den MSCI-Ratingkriterien aufweisen	100 %

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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 hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	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
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F	P	P	P

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

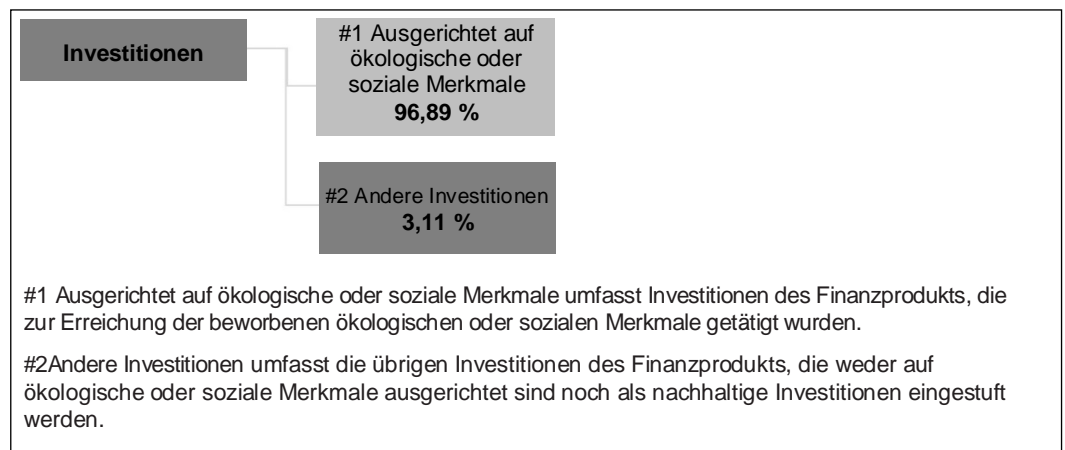
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Tri-party Citigroup Global Markets	Finanzinstitute	3,35 %	Vereinigte Staaten
Tri-party BNP Paribas	Finanzinstitute	2,83 %	Vereinigte Staaten
Tri-party BOFA Securities Inc.	Finanzinstitute	2,52 %	Vereinigte Staaten
Tri-party J.P. Morgan Securities I	Finanzinstitute	2,45 %	Vereinigte Staaten
Tri-party BOFA Securities Inc.	Finanzinstitute	2,20 %	Vereinigte Staaten
Tri-party BNP Paribas	Finanzinstitute	2,07 %	Vereinigte Staaten
Tri-party BOFA Securities Inc.	Finanzinstitute	2,01 %	Vereinigte Staaten
Tri-party J.P. Morgan Securities I	Finanzinstitute	1,64 %	Vereinigte Staaten
Tri-party BOFA Securities Inc.	Finanzinstitute	1,60 %	Vereinigte Staaten
Tri-party Citigroup Global Markets	Finanzinstitute	1,50 %	Vereinigte Staaten
Skandinaviska Enskilda Banken AB	Finanzinstitute	1,14 %	Vereinigte Staaten
Tri-party Citigroup Global Markets	Finanzinstitute	1,09 %	Vereinigte Staaten
Tri-party J.P. Morgan Securities I	Finanzinstitute	1,09 %	Vereinigte Staaten
Mizuho Bank Ltd (Zweigniederlassung New York)	Finanzinstitute	0,93 %	Vereinigte Staaten
Canadian Imperial Bank Of Commerce	Finanzinstitute	0,87 %	Kanada



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerte an.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	65,41 %
Finanzinstitute	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	15,19 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	4,34 %
Agency-Anleihen	Gehalten Ohne Garantie	3,74 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	2,53 %
Agency-Anleihen	Von der Regierung garantiert	1,59 %
Kommunalanleihen	Sonstige	1,31 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

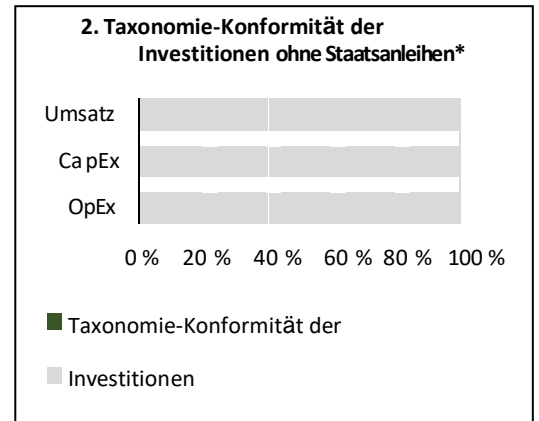
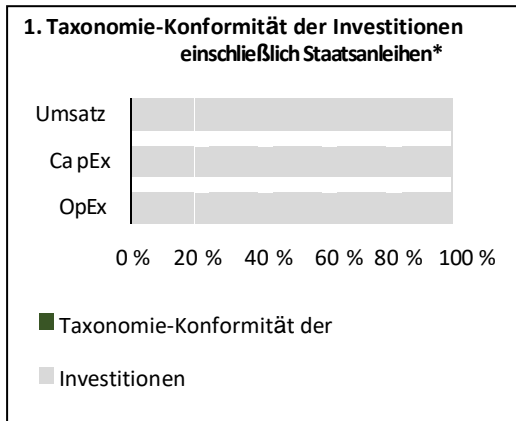
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)


Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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.

 *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?**

Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

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 von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund

Unternehmenskennung:

5493003UB3VZ7MRZU371

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input type="checkbox"/> <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 ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthält 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 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

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 mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung
- Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen haben, wie von MSCI oder in einem anderen externen ESG-Research-Anbieter, den der Anlageverwalter von Zeit zu Zeit einsetzt, bestimmt

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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.	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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 hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streu-munition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	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
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F	P	P	P

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

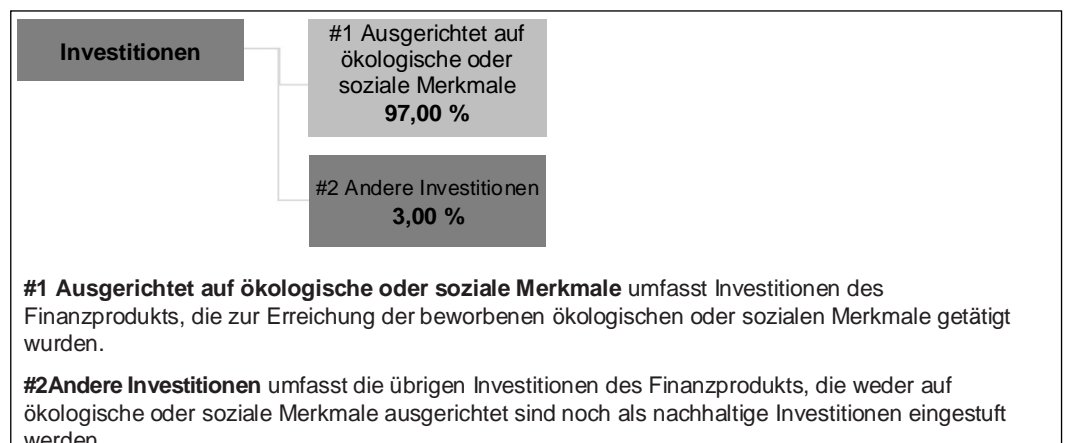
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Tri-party BNP Paribas	Finanzinstitute	3,12 %	Vereinigte Staaten
Tri-party BNP Paribas	Finanzinstitute	2,36 %	Vereinigte Staaten
Tri-party J.P. Morgan Securities I	Finanzinstitute	1,94 %	Vereinigte Staaten
Tri-party BNP Paribas	Finanzinstitute	1,37 %	Vereinigte Staaten
Skandinaviska Enskilda Banken AB	Finanzinstitute	1,16 %	Vereinigte Staaten
Skandinaviska Enskilda Banken AB	Finanzinstitute	1,08 %	Vereinigte Staaten
Royal Bank of Canada (Zweigniederlassung Toronto)	Finanzinstitute	1,06 %	Kanada
Tri-party Goldman Sachs & Co. LLC	Finanzinstitute	1,05 %	Vereinigte Staaten
Royal Bank of Canada (Zweigniederlassung Toronto)	Finanzinstitute	0,98 %	Kanada
Royal Bank of Canada (Zweigniederlassung Toronto)	Finanzinstitute	0,92 %	Kanada
Tri-party BNP Paribas	Finanzinstitute	0,86 %	Vereinigte Staaten
Mizuho Bank Ltd (Zweigniederlassung New York)	Finanzinstitute	0,73 %	Vereinigte Staaten
Skandinaviska Enskilda Banken AB	Finanzinstitute	0,68 %	Vereinigte Staaten
KBC Bank NV (Zweigniederlassung New York)	Finanzinstitute	0,63 %	Vereinigte Staaten
Mizuho Bank Ltd (Zweigniederlassung New York)	Finanzinstitute	0,57 %	Vereinigte Staaten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerte an.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	78,21 %
Agency-Anleihen	Gehalten Ohne Garantie	3,46 %
Finanzinstitute	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	3,09 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	3,08 %
Kommunalanleihen	Sonstige	2,45 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	2,30 %
Sonstige	Sonstige	2,23 %
Agency-Anleihen	Von der Regierung garantiert	2,05 %
Staatsanleihen	Sonstige	1,28 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

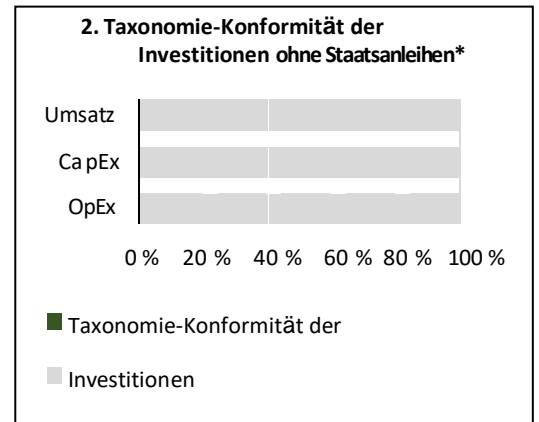
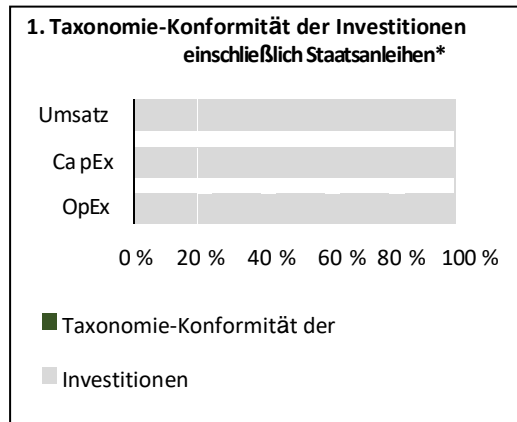
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



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 Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.



*Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

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 von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:

BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund

Unternehmenskennung:

549300S5H1NIVFSPNC81

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> 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 ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthält 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 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

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 mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen
- Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen
- Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung
- Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen
- 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

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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	Performance im Bezugszeitraum
Ausschluss von Emittenten, die mit der Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Herstellung von Feuerwaffen und Kleinwaffenmunition für zivile Zwecke tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb dieser Waffen und Munition erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder aus der Stromerzeugung.	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
Ausschluss von Emittenten, die in der Produktion von Tabakwaren tätig sind und/oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Einzelhandel, dem Vertrieb und/oder der Lizenzierung von Tabakwaren erzielen	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null
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.	# Anzahl der gemeldeten aktiven Verstöße	null

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

Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.

- **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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Abschnitt 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 PAIs 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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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 hat die Auswirkungen der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren durch die Anwendung dieser ESG-Mindest- und Ausschlusskriterien berücksichtigt. Der Anlageverwalter hat festgelegt, dass im Rahmen der Anlageauswahlkriterien die in der nachstehenden Tabelle mit „F“ gekennzeichneten PAI vollständig oder mit „P“ gekennzeichneten PAI teilweise berücksichtigt werden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren			
	Ausschluss von Emittenten, die mit Produktion kontroverser Waffen (Atomwaffen, Streumunition, biologisch-chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran oder Brandwaffen) in Verbindung stehen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und/oder der Raffination fossiler Brennstoffe erzielen	Ausschluss von Emittenten, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Gewinnung und/oder Erzeugung von Kraftwerkskohle oder Stromerzeugung aus Kernenergie erzielen	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
Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	F	P	P	P

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)



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. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

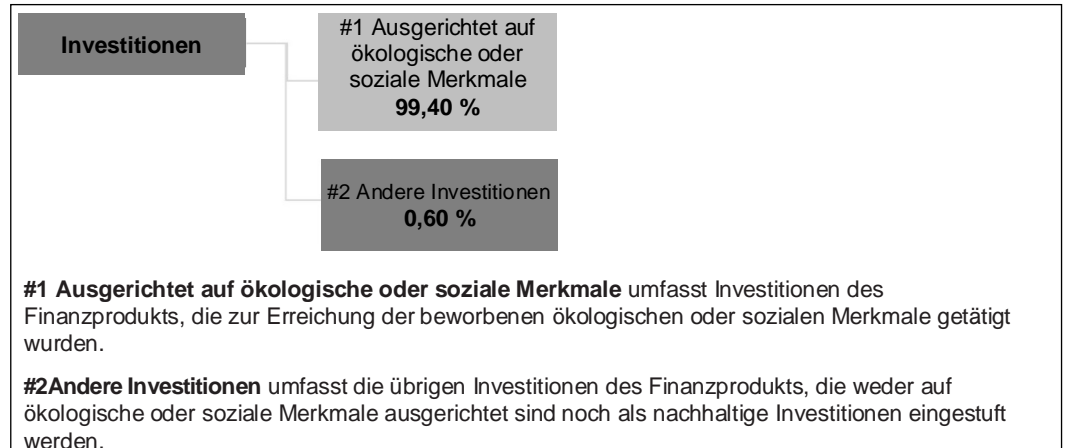
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BLK ICS USD Liq Agency	STIF Funds	4,73 %	Irland
National Bank Of Canada	Finanzinstitute	0,83 %	Kanada
Canadian Imperial Bank Of Commerce	Finanzinstitute	0,83 %	Vereinigte Staaten
Bank Of America NA	Finanzinstitute	0,70 %	Vereinigte Staaten
Royal Bank Of Canada (Zweigniederlassung New York)	Finanzinstitute	0,69 %	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Inc.	Finanzinstitute	0,69 %	Vereinigte Staaten
DNB Bank Asa	Finanzinstitute	0,69 %	Norwegen
Nordea Bank Abp	Finanzinstitute	0,64 %	Finnland
Bayerische Landesbank (Zweigniederlassung New York)	Kommunalanleihen	0,63 %	Vereinigte Staaten
Credit Agricole Corporate And Inve	Finanzinstitute	0,63 %	Frankreich
Lloyds Bank Corporate Markets plc	Finanzinstitute	0,62 %	Vereinigte Staaten
Westpac Banking Corp	Finanzinstitute	0,62 %	Australien
Skandinaviska Enskilda Banken AB	Finanzinstitute	0,62 %	Schweden
Societe Generale SA	Finanzinstitute	0,55 %	Frankreich
Royal Bank Of Canada (Zweigniederlassung New York)	Finanzinstitute	0,52 %	Vereinigte Staaten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerte an.



INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, die 1 % oder mehr der Fondsanlagen ausmachen und in denen der Fonds während des Bezugszeitraums engagiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Finanzinstitute	Banken	55,22 %
Industrie	Zyklische Konsumgüter	5,06 %
STIF Funds	Sonstige	4,73 %
Finanzinstitute	Finanzunternehmen	4,24 %
Industrie	Investitionsgüter	3,46 %
Finanzinstitute	Brokerage/Vermögensverwalter/Börsen	2,77 %
Finanzinstitute	Sonstige Finanzwerte	2,58 %
Industrie	Grundstoffe	2,57 %
Industrie	Technologie	2,47 %
Industrie	Kommunikation	2,41 %
Versorger	Strom	2,40 %
Industrie	Energie	1,93 %
Kommunalanleihen	Sonstige	1,74 %
Versorger	Erdgas	1,51 %
Industrie	Basiskonsumgüter	1,43 %

Während des Bezugszeitraums wurden keine der Fondsanlagen in Sektoren gehalten, die Einnahmen aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Produktion, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel, von fossilen Brennstoffen erzielen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

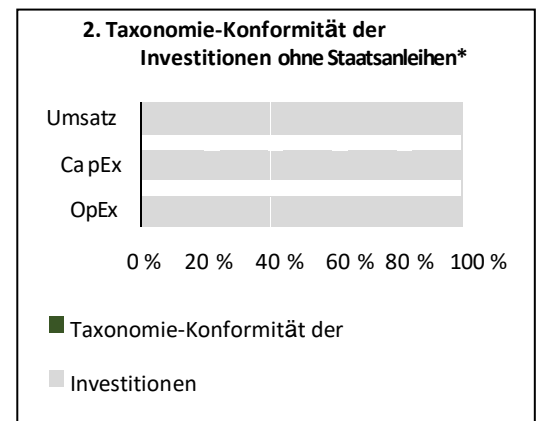
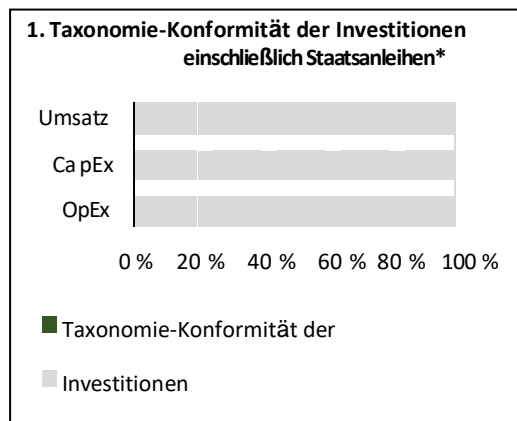
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Im Bezugszeitraum waren 0 % der Fondsanlagen auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

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.

 *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?**
Im Bezugszeitraum sind 0 % der Fondsanlagen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Da dies der erste Zeitraum ist, in dem die Offenlegung regelmäßiger 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 wirksam ist, werden keine Vergleichsdaten vorgelegt.



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 wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den unter „#2 Andere Investitionen“ erfassten Anlagen gehörten Zahlungsmittel, Geldmarktfonds und Aktien oder Anteile von Investmentfonds und festverzinslichen Wertpapieren (auch als Schuldverschreibungen bekannt), die von Regierungen und Behörden weltweit begeben wurden. 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.

INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC

NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (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.

Sie wünschen weitere Auskünfte?

blackrockinternational.com | +44 (0)20 7743 3300

© 2022 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

